

路博迈添航债券型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：路博迈基金管理（中国）有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 02 月 11 日（基金合同生效日）起至 2026 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
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	49
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	50
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	50

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	50
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.11 投资组合报告附注	50
§ 8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
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	52
§ 9 开放式基金份额变动	52
§ 10 重大事件揭示	53
10.1 基金份额持有人大会决议	53
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	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4 基金投资策略的改变	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	53
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	53
10.8 其他重大事件	54
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	55
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	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	55
§ 12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录	56
12.2 存放地点	56
12.3 查阅方式	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	路博迈添航债券型证券投资基金	
基金简称	路博迈添航债券	
基金主代码	026189	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2026 年 2 月 11 日	
基金管理人	路博迈基金管理（中国）有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	135, 073, 302. 68 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	路博迈添航债券 A	路博迈添航债券 C
下属分级基金的交 易代码	026189	026190
报告期末下属分级 基金的份额总额	134, 862, 381. 03 份	210, 921. 65 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在控制风险并保持资产流动性的前提下，努力追求组合资产长期稳健增值。
投资策略	基金管理人将以“自上而下”角度、以资产配置思路来构建组合。在资产配置层面将重点关注各类资产的未来收益变化情况，根据不同资产的收益做第一层面的配置，关注较为长期的影响资产收益波动的关键力量。本基金具体的投资策略包括资产配置策略、债券投资策略、股票及港股通投资策略、基金投资策略、流动性管理策略以及衍生产品投资策略等。
业绩比较基准	中债-综合全价(总值)指数收益率×84%+中证 800 指数收益率×10%+恒生指数收益率×1%+人民币活期存款收益率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险及预期收益水平理论上高于货币市场基金，低于混合型基金及股票型基金。本基金可投资港股通标的股票，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		路博迈基金管理（中国）有限公司	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘铮	张立学
	联系电话	4008755888	010-68858126
	电子邮箱	cs@nbchina.com	zhanglixue@psbcoa.com.cn
客户服务电话		4008755888	95580

传真	021-32063700	010-86353609
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 88 号 30 层 11 单元	北京市西城区金融大街 3 号
办公地址	上海市静安区石门一路 288 号香港兴业中心二座 7 楼 705-710 室	北京市西城区金融大街 3 号 A 座
邮政编码	200041	100808
法定代表人	阎小庆	郑国雨

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.nbchina.com
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	路博迈基金管理（中国）有限公司	中国上海市静安区石门一路 288 号香港兴业中心二座 7 楼 705-710 室

§ 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 2 月 11 日（基金合同生效日）-2026 年 6 月 30 日	
	路博迈添航债券 A	路博迈添航债券 C
本期已实现收益	1,627,177.55	1,905.45
本期利润	1,865,797.14	1,769.20
加权平均基金份额 本期利润	0.0086	0.0059
本期加权平均净 值利润率	0.86%	0.59%
本期基金份额净 值增长率	0.76%	0.69%
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	1,030,948.22	1,449.09
期末可供分配基 金份额利润	0.0076	0.0069

期末基金资产净值	135,893,329.25	212,370.74
期末基金份额净值	1.0076	1.0069
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	0.76%	0.69%

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（例如，申购、赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

4、本基金合同于 2026 年 02 月 11 日生效，截止本报告期末，本基金成立未满六个月。

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

路博迈添航债券 A

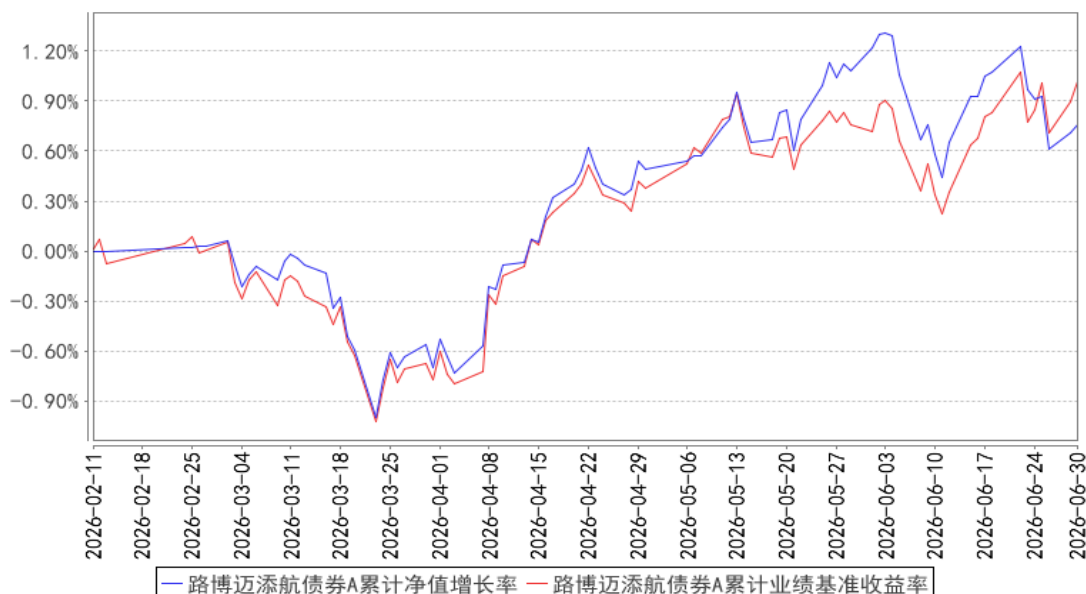
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	1.47%	0.15%	1.80%	0.15%	-0.33%	0.00%
自基金合同生效起至今	0.76%	0.14%	1.01%	0.15%	-0.25%	-0.01%

路博迈添航债券 C

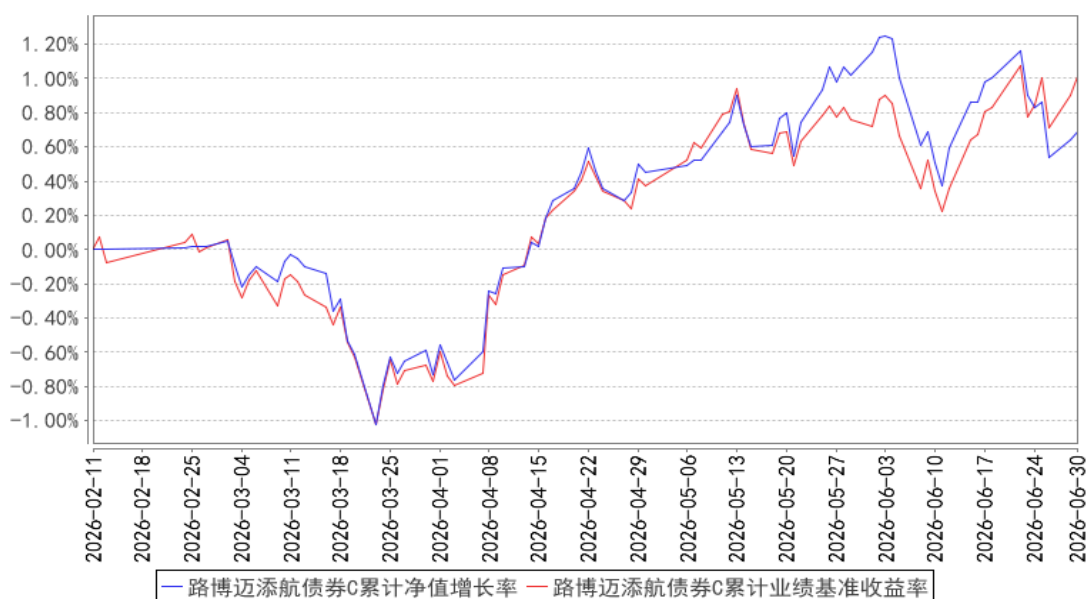
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	1.43%	0.15%	1.80%	0.15%	-0.37%	0.00%
自基金合同生效起至今	0.69%	0.14%	1.01%	0.15%	-0.32%	-0.01%

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

路博迈添航债券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



路博迈添航债券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：1、本基金的基金合同于 2026 年 02 月 11 日生效，截至本报告期末，本基金合同生效未满一年。

2、本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，截至报告期末本基金仍在建仓期。

§ 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

路博迈基金管理（中国）有限公司于 2021 年 9 月 22 日经中国证券监督管理委员会《关于核

准设立路博迈基金管理（中国）有限公司的批复》（证监许可[2021]3094 号）批准设立，由路博迈投资顾问有限公司（Neuberger Berman Investment Advisers LLC）全资持有。截至报告期末，公司共管理 20 只公开募集证券投资基金：路博迈护航一年持有期债券型证券投资基金、路博迈中国机遇混合型证券投资基金、路博迈中国绿色债券债券型证券投资基金、路博迈中国医疗健康股票型发起式证券投资基金、路博迈中国精选利率债债券型证券投资基金、路博迈安航 90 天持有期债券型证券投资基金、路博迈中高等级信用债债券型证券投资基金、路博迈资源精选股票型发起式证券投资基金、路博迈悦航 30 天持有期债券型证券投资基金、路博迈 CFETS0-5 年期气候变化高等级债券综合指数证券投资基金、路博迈中证 A500 指数增强型证券投资基金、路博迈兴航 60 天滚动持有债券型证券投资基金、路博迈旭航债券型证券投资基金、路博迈上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金、路博迈中债优选投资级信用债指数证券投资基金、路博迈港股通科技股票型证券投资基金、路博迈中证 A 股指数增强型证券投资基金、路博迈添航债券型证券投资基金、路博迈卓越优选混合型证券投资基金、路博迈中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金。

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		
韩羽辰	本基金现任基金经理	2026 年 2 月 11 日	-	9 年	韩羽辰，中国国籍，纽约大学金融工程专业硕士。于 2025 年 1 月加入路博迈基金管理（中国）有限公司，现任公募多资产投资部基金经理。曾任职于光大保德信基金管理有限公司，历任研究助理、量化研究员、投资经理、基金经理职务，负责量化产品的投资研究等工作。
王栋	本基金现任基金经理	2026 年 2 月 11 日	-	4 年	王栋，中国国籍，浙江大学会计学硕士。于 2025 年 2 月加入路博迈基金管理（中国）有限公司，现任公募固收投资部联席总经理、基金经理。自 2007 年 7 月至 2025 年 2 月，其先后于中国民生银行深圳分行担任金融同业部业务经理；平安银行股份有限公司担任固定收益部投资经理；平安理财有限责任公司担任固定收益部投资经理；达诚基金管理有限公司担任固定收益部部门总监、基金经理。

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期。

2、非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和

解聘日期。

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

4.1.3 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

截至本报告期末，本基金的基金经理不存在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合规守信情况的说明

本基金管理人在报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，本着诚实信用、勤勉尽职的原则为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的行为。

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

公司所有研究成果对公司所管理的所有产品公平开放，基金经理严格遵守公平、公正、独立的原则下达投资指令，所有投资指令在中央交易室集中执行，投资交易过程公平公正，投资交易监控贯穿于整个投资过程。

本基金管理人通过建立事前、事中和事后全程嵌入式的管控模式，确保公平交易制度的执行和实现。本基金管理人建立了内部公平交易管理规范 and 流程，以确保公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种及投资管理的各个环节。本着“时间优先、价格优先”的原则，对同一证券有相同交易需求的投资组合采用交易系统内的公平交易模块，实现事中交易执行层面的公平管控。

本报告期内，投资交易监控与价差分析未发现投资组合之间存在利益输送等不公平交易行为，公平交易制度整体执行情况良好。

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。本基金与其他投资组合未发生交易所公开竞价同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的交易。

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，宏观经济在结构优化中彰显韧性。高技术制造业与科技相关产业保持强劲增长，成为支撑经济的重要引擎，传统消费与制造业则在政策呵护下逐步积蓄修复动能。GDP 运行于年度目标区间，二季度价格指数迎来标志性改善，名义增速边际回暖，内生增长活力持续释放。

A 股市场在牛市格局中演绎出鲜明的结构分化特征，以科创板和创业板为代表的科技板块大幅领

涨，传统蓝筹指数则有所调整。风格层面，成长显著跑赢价值，科技成长赛道走出独立行情，大小盘、成长与价值之间的分化达到历史极值。市场成交极为活跃，但赚钱效应高度集中，全市场近七成个股下跌，多数个股并未跟上指数涨幅，行业间首尾差距悬殊，电子、通信等 AI 相关行业表现耀眼，而商贸零售、农林牧渔、食品饮料等传统板块持续承压。资金面同样折射出极端偏好，杠杆资金持续加码，但新增融资高度集中于科技行业，对其他板块形成明显的流动性“虹吸”效应。总体而言，上半年是科技主线引领的结构性牛市，更是中国经济转型升级在资本市场的生动映射，分化中蕴藏着丰富的结构性机遇。

回顾上半年债券市场，核心运行特征是需求端和资产供给端的阶段性错位，产生了持续的“资产荒”现象。需求端，资金面从 3 月中旬开始以 DR001 为代表的短端利率走势明显下行，在 5 月末之前持续稳定在 1.3% 之下，并出现多日靠近 1.2% 的情况；此外银行存款高增，金融机构各项存款余额 1 月同比增长 9.9%，增幅较高，6 月末同比仍然有 8.2% 的增幅。而资产供给端，社会存量融资规模同比增速从年初的 8.2% 下滑到 6 月末的 7.4%；社融分项内部，比较核心的人民币贷款月度同比增速从 1 月的 6.1% 下滑到 6 月的 5.2%，存款同比增速与贷款同比增速差比较明显。央行 5 月发布的《2026 年第一季度货币政策执行报告》指出，银行债券投融资行为已经成为影响货币供应和信用创造的重要渠道。债市需求和供给阶段性的错位，构成了上半年固收市场的主要影响因素。

本基金以风险平价模型为资产配置基础，股票组合采用机器学习框架驱动的选股模型，依托高性能算力对海量历史数据进行深度挖掘，构建符合长期市场逻辑的综合选股指标，并在控制风格行业偏离和跟踪误差的基础上优选个股构建股票投资组合，力争实现长期稳健的超额收益。固收组合保持较长久期，以信用债投资为主，加部分利率债投资。信用债投资，期限上以 2-7 年普通信用债和 3-10 年二级资本债为重点；利率债投资，主要目的是参与短期交易、博取利差为主，品种上以 20 年以上超长利率债为主，并根据资金利率变化适当采取杠杆策略。上半年信用债利差、政金债与国债的税差，总体呈现压缩态势。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 类份额净值 1.0076 元，本报告期内净值增长率 0.76%，同期业绩比较基准收益率 1.01%；截至本报告期末，本基金 C 类份额净值 1.0069 元，本报告期内净值增长率 0.69%，同期业绩比较基准收益率 1.01%。

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，积极因素正在积聚，宏观经济有望在政策加力下保持平稳向好态势。“十五五”开局之年的产业政策持续发力，新质生产力加速培育，出口依托完备产业链保持韧性，内需修复

将成为政策重点发力方向，财政与货币协同发力可期，经济增速有望在筑底后温和回升，物价水平也将在需求端支撑下趋于改善，三季度将是观察名义增速修复成色的重要窗口，前景值得期待。证券市场方面，科技仍是贯穿全年的核心主线，但行情驱动力或将从估值扩张稳步切换至业绩兑现，中报季将成为验证企业盈利成色的试金石，真正具备产业趋势支撑的优质龙头将在优胜劣汰中脱颖而出，市场风格也有望从极致分化向均衡收敛，成长与价值各展所长。尽管地缘政治和通胀扰动等外部不确定性犹存，但国内政策工具箱充足，产业升级趋势不可逆转，科技板块的高景气具备基本面支撑，交易拥挤将在市场自我调节中逐步消化。行业配置上，关注 AI 产业链上业绩确定性强的硬件环节，侧重海外供应链受益方向，同时关注 AI 资本开支外溢带来的电力设备、机器人、商业航天等衍生机会；锂电池、化工、券商、创新药等处于盈利复苏通道的板块也值得密切跟踪；消费与红利板块经过持续调整后估值渐具吸引力，可逐步左侧布局。整体而言，下半年 A 股结构性机会丰富，市场有望在分化中逐步走向均衡，产业变迁与资产重估的主线清晰，值得积极把握。总的来说，2026 年或将是连接短期复苏与中长期高质量发展的重要一年。资本市场有望在盈利驱动下，呈现出机会更为多元、风格更趋均衡的特征。

下半年债市走势的主要影响因素包括：

一是经济基本面走势，也即信贷和社融增速能否有所恢复，上半年供需的错位能否有所改善，以及社融和人民币信贷扩张态势，目前来看比较依赖财政政策的发力，需重点关注财政供给节奏是否有明显的边际变化。上半年政府债券发行较往年偏慢，我们统计上半年政府债券净融资发行规模在 6.6 万亿左右，同比去年少发行约 1.4 万亿左右，根据往年进度，三季度尤其是 8、9 月份可能会增加供给，从而对债市产生一定的扰动。

二是关注资金面，上半年 DR001 维持在 1.2% - 1.35% 的低位，总体比较宽松，但进入 6 月后 DR001 明显反弹，跨入 7 月后目前仍在 1.35% - 1.4% 区间窄幅震荡，暂时难以回到 1.3%。如果资金不能回落到 1.35% 以下，叠加目前债市利率较低，那么债市三季度继续下行空间或较为有限，央行在 4 月以后持续回笼部分长期资金是重要影响因素。

三是机构投资者行为和监管动作，进入三季度，市场对基金申赎、保险配置行为等更加关注，部分债市投资者上半年浮盈较多，若三季度扰动因素增多，需要关注 8 月以后是否会出现预防性赎回。监管方面，市场关注部分评级虚高债券的后续调整，以及定制债基整改是否有进一步动作，这可能引发债券资产的抛售和负债端的赎回等。

综上我们认为三季度走势比二季度要复杂一些，但目前债市整体仍处于牛市环境中，货币政策总体宽松，新旧经济转型对社会融资规模扩张、消费增长有一定拖累，低利率环境还将持续一段时间。债市即便出现调整，其幅度可能较为有限，出现调整反而是加仓配置的较好时机。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，委托基金服务机构对基金所持有的投资品种进行估值，本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。基金管理人及委托的基金服务机构严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，基金份额净值经基金托管人复核无误后由基金管理人对外披露。

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、本基金基金合同的约定以及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

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在路博迈添航债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《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，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、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：路博迈添航债券型证券投资基金

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	1,195,577.99
结算备付金		347,842.46
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	161,793,499.00
其中：股票投资		16,487,912.41
基金投资		-
债券投资		145,305,586.59
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	6.4.7.5	-
资产总计		163,336,919.45
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		27,001,849.32
应付清算款		-
应付赎回款		79,924.14
应付管理人报酬		73,543.73
应付托管费		18,385.96
应付销售服务费		35.78
应付投资顾问费		-
应交税费		4,810.89
应付利润		-

递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	52,669.64
负债合计		27,231,219.46
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	135,073,302.68
未分配利润	6.4.7.8	1,032,397.31
净资产合计		136,105,699.99
负债和净资产总计		163,336,919.45

注：1、报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 135,073,302.68 份，其中 A 类基金份额净值 1.0076 元，基金份额 134,862,381.03 份；C 类基金份额净值 1.0069 元，基金份额 210,921.65 份。

2、本基金基金合同于 2026 年 02 月 11 日生效，无上年度末数据。

6.2 利润表

会计主体：路博迈添航债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 2 月 11 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 2 月 11 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		2,649,151.95
1. 利息收入		339,727.36
其中：存款利息收入	6.4.7.9	31,655.11
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		308,072.25
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,070,941.25
其中：股票投资收益	6.4.7.10	316,121.10
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	1,526,956.90
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.13	-
股利收益	6.4.7.14	227,863.25
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	238,483.34
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-

减：二、营业总支出		781,585.61
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	500,106.63
2. 托管费	6.4.10.2.2	125,026.66
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	229.89
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		113,282.25
其中：卖出回购金融资产支出		113,282.25
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-
7. 税金及附加		3,650.98
8. 其他费用	6.4.7.18	39,289.20
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,867,566.34
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,867,566.34
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		1,867,566.34

注：本基金基金合同于 2026 年 02 月 11 日生效，无上年度可比期间数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：路博迈添航债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 2 月 11 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 2 月 11 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 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	262,272,293.38	-	262,272,293.38
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-127,198,990.70	1,032,397.31	-126,166,593.39
（一）、综合收益总额	-	1,867,566.34	1,867,566.34
（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）	-127,198,990.70	-835,169.03	-128,034,159.73
其中：1. 基金申购款	1,180,669.74	6,517.40	1,187,187.14
2. 基金赎回款	-128,379,660.44	-841,686.43	-129,221,346.87

(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	135,073,302.68	1,032,397.31	136,105,699.99

注：本基金基金合同于 2026 年 02 月 11 日生效，无上年度可比期间数据。

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>阎小庆</u>	<u>阎小庆</u>	<u>黄恩典</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

路博迈添航债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2025 年 11 月 3 日证监许可【2025】2446 号《关于准予路博迈添航债券型证券投资基金注册的批复》准予注册，本基金由基金管理人依照《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规以及《路博迈添航债券型证券投资基金基金合同》的规定公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定。基金管理人和注册登记机构均为路博迈基金管理（中国）有限公司，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。有关基金募集文件已按规定向中国证监会备案，基金合同于 2026 年 2 月 11 日正式生效，生效日的基金份额总额为 262,272,293.38 份，经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）验字第 2600081 号验资报告予以验证。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、信用衍生品、国债期货、银行存款、同业存单、现金、经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金（不包含 QDII 基金、香港互认基金、基金中基金和其他投资范围包含基金的基金、货币市场基金，仅包括全市场的股票型 ETF 及基金管理人旗下的股票型基金、计入权益类资产的混合型基金。）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监

会相关规定)。

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。

本基金业绩比较基准:中债-综合全价(总值)指数收益率 $\times$ 84%+中证 800 指数收益率 $\times$ 10%+恒生指数收益率 $\times$ 1%+人民币活期存款收益率(税后) $\times$ 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求,同时亦按照中国证券投资基金业协会(以下简称“基金业协会”)颁布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》、《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况、自 2026 年 2 月 11 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2026 年 2 月 11 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

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

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

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

除非本基金改变管理金融资产的业务模式,在此情形下,所有受影响的相关金融资产在业务

模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

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

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

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

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

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

(b) 金融负债的分类

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

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

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

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(a) 金融工具的初始确认

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

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

(b) 后续计量

– 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

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

– 以摊余成本计量的金融资产

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

– 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

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

– 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

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

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

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

(d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

– 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

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

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

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

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

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

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

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

核销

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

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

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

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

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

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

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

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

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

6.4.4.7 实收基金

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

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包

含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占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进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

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

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

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

公允价值变动收益

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

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

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其持有的本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别选择不同的分红方式，同一投资者持有的同一类别的基金份额只能选择一种分红方式。如投资者在不同销售机构选

择的分红方式不同，基金登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准；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；同一类别内每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 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入账。

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

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、中投信(2021)20号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部税务总局公告2023年第2号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部税务总局中国证监会公告2023年第23号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照3%的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，自2026年1月1日至2027年12月31日，免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以

及一般存款利息收入不征收增值税。自 2025 年 8 月 8 日起, 对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入, 恢复征收增值税, 对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入, 继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务, 以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b) 对投资者从本基金分配中取得的收入, 暂不征收企业所得税。

对本基金从中国内地证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股票的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不征收企业所得税。

c) 对本基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司(“挂牌公司”)取得的股息红利所得, 持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的, 暂减按 50% 计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 暂免征收个人所得税。对本基金持有的上市公司限售股, 解禁后取得的股息、红利收入, 按照上述规定计算纳税, 持股时间自解禁日起计算; 解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利, H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称中国结算)提出申请, 由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册, H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利, 由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。对本基金通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得, 按照上述规定计征个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得, 继续暂免征收个人所得税, 执行至 2027 年 12 月 31 日。

d) 本基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税, 买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起, 证券交易印花税实施减半征收。对于本基金通过沪港通、深港通买卖、继承、赠与与联交所上市股票, 按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	1,164,934.28
等于：本金	1,164,751.20
加：应计利息	183.08
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	30,643.71
等于：本金	30,629.18
加：应计利息	14.53
减：坏账准备	-
合计	1,195,577.99

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 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		16,933,667.39	-	16,487,912.41	-445,754.98
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	9,969,214.11	104,526.03	10,134,526.03	60,785.89
	银行间市场	132,897,547.57	1,650,060.56	135,171,060.56	623,452.43
	合计	142,866,761.68	1,754,586.59	145,305,586.59	684,238.32
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		159,800,429.07	1,754,586.59	161,793,499.00	238,483.34

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/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 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	13,643.00
其中：交易所市场	-
银行间市场	13,643.00
应付利息	-
预提费用-审计费	17,284.40
预提费用-信息披露费	21,604.80
其他应付	137.44
合计	52,669.64

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

路博迈添航债券 A

项目	本期 2026 年 2 月 11 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	261,896,948.91	261,896,948.91
本期申购	1,179,415.10	1,179,415.10
本期赎回（以“-”号填列）	-128,213,982.98	-128,213,982.98
本期末	134,862,381.03	134,862,381.03

路博迈添航债券 C

项目	本期 2026 年 2 月 11 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	375,344.47	375,344.47
本期申购	1,254.64	1,254.64
本期赎回(以“-”号填列)	-165,677.46	-165,677.46
本期末	210,921.65	210,921.65

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 02 月 11 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 262,272,293.38 份基金份额，其中认购资金利息折合 53,729.73 份基金份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

路博迈添航债券 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	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	1,627,177.55	238,619.59	1,865,797.14
本期基金份额交易产生的变动数	-419,301.58	-415,547.34	-834,848.92
其中：基金申购款	5,122.38	1,380.25	6,502.63
基金赎回款	-424,423.96	-416,927.59	-841,351.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,207,875.97	-176,927.75	1,030,948.22

路博迈添航债券 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	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	1,905.45	-136.25	1,769.20
本期基金份额交易产生的变动数	-180.02	-140.09	-320.11
其中：基金申购款	6.96	7.81	14.77
基金赎回款	-186.98	-147.90	-334.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,725.43	-276.34	1,449.09

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 2 月 11 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

活期存款利息收入	22,812.68
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	946.34
结算备付金利息收入	7,842.46
其他	53.63
合计	31,655.11

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利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 2 月 11 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	46,834,406.84
减：卖出股票成本总额	46,428,300.72
减：交易费用	89,985.02
买卖股票差价收入	316,121.10

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年2月11日（基金合同生效日）至2026年6 月30日
债券投资收益——利息收入	1,052,695.11
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	474,261.79
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,526,956.90

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年2月11日（基金合同生效日）至2026年 6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	280,098,188.88
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	276,686,562.70

减：应计利息总额	2,928,199.46
减：交易费用	9,164.93
买卖债券差价收入	474,261.79

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无买卖权证差价收入。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具其他投资收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 2 月 11 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	227,863.25
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	227,863.25

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 2 月 11 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	238,483.34
股票投资	-445,754.98
债券投资	684,238.32
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	238,483.34

6.4.7.16 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 2 月 11 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	17,284.40
信息披露费	21,604.80
证券出借违约金	—
开户费	400.00
合计	39,289.20

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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期内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
路博迈基金管理（中国）有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金直销机构
中国邮政储蓄银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 2 月 11 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	500,106.63
其中：应支付销售机构的客户维护费	249,609.49
应支付基金管理人的净管理费	250,497.14

注：支付基金管理人路博迈基金的基金管理费按前一日基金资产净值扣除基金资产中本基金管理人管理的其他基金份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值扣除基金资产中本基金管理人管理的其他基金份额所对应资产净值后剩余部分×0.60%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 2 月 11 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	125,026.66

注：支付基金托管人中国银行的基金托管费按前一日基金资产净值扣除基金资产中本基金托管人托管的其他基金份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值扣除基金资产中本基金托管人托管的其他基金份额所对应资产净值后剩余部分×0.15%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 2 月 11 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销售服务费		
	路博迈添航债券 A	路博迈添航债券 C	合计
中国邮政储蓄银行股份有限公司	-	229.87	229.87
合计	-	229.87	229.87

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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 2 月 11 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
中国邮政储蓄银行股份有限公司	1,164,934.28	22,812.68

注：本基金的银行存款由基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 27,001,849.32 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
102485101	24 中国环 保 MTN001	2026 年 07 月 01 日	104.00	100,000	10,399,974.25
102485241	24 金圆投 资 MTN004A	2026 年 07 月 01 日	102.86	11,000	1,131,435.59
190209	19 国开 09	2026 年 07 月 01 日	103.36	22,000	2,273,868.77
210215	21 国开 15	2026 年 07 月 01 日	110.18	53,000	5,839,404.96
232580055	25 徽商银 行二级资 本债 01	2026 年 07 月 01 日	103.24	100,000	10,324,415.34
合计				286,000	29,969,098.91

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益水平理论上高于货币市场基金，低于混合型基金及股票型基金。本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人制定了内部管理制度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。

公司建立架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系。风险管理机构由董事会及风险控制委员会、总经理及风险管理委员会、督察长、风控负责人、法律合规部、风险管理部以及各个业务部门组成。公司各部门或岗位之间的监督制约，构成风险控制的第一道监控防线；由公司总经理负责，风险管理委员会、投资决策委员会、督察长、风控负责人、法律合规部和风险管理部构成风险控制的第二道监控防线；在董事会领导下，风险控制委员会负责内部控制和风险管理的决策，构成了风险控制的第三道监控防线。

6.4.13.2 信用风险

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金于本报告期末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日
AAA	73,297,471.23
AAA 以下	—
未评级	72,008,115.36
合计	145,305,586.59

注：1、债券评级取自第三方评级机构。

2、债券投资以全价列示。

3、未评级债券为中期票据、政策性金融债、国债及公司债等无信用评级的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

流动性风险发生时，本基金的基金管理人按流动性风险处置预案处理。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人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严格按照《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》等有关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。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金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。

本基金本报告期末无重大流动性风险。

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。

本基金持有的利率敏感性资产主要为货币资金、结算备付金和债券投资等。下表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

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 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,195,577.99	-	-	-	1,195,577.99
结算备付金	347,842.46	-	-	-	347,842.46
交易性金融资产	10,335,767.12	81,774,825.22	53,194,994.25	16,487,912.41	161,793,499.00
资产总计	11,879,187.57	81,774,825.22	53,194,994.25	16,487,912.41	163,336,919.45
负债					
卖出回购金融资产款	27,001,849.32	-	-	-	27,001,849.32
应付赎回款	-	-	-	79,924.14	79,924.14
应付管理人报酬	-	-	-	73,543.73	73,543.73
应付托管费	-	-	-	18,385.96	18,385.96
应付销售服务费	-	-	-	35.78	35.78
应交税费	-	-	-	4,810.89	4,810.89
其他负债	-	-	-	52,669.64	52,669.64
负债总计	27,001,849.32	-	-	229,370.14	27,231,219.46
利率敏感度缺口	-15,122,661.75	81,774,825.22	53,194,994.25	16,258,542.27	136,105,699.99

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

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变；此项影响并未考虑管理层为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2026 年 6 月 30 日）
	市场利率上升 25 个基点	-1,789,220.47

	市场利率下降 25 个基点	1,842,594.09
--	------------------	--------------

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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票、债券及基金，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。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 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	16,487,912.41	12.11
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	16,487,912.41	12.11

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	5,938,349.41

	5%	
	业绩比较基准下降	
	5%	-5,938,349.41

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下： 第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价； 第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值； 第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日
第一层次	16,487,912.41
第二层次	145,305,586.59
第三层次	-
合计	161,793,499.00

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。 对于证券交易所上市的股票和可转换债券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金分别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不会将相关股票和可转换债券等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，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。 本报告期间，本基金无公允价值所属层次间的重大变动。
--

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

截至 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	16,487,912.41	10.09
	其中：股票	16,487,912.41	10.09
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	145,305,586.59	88.96
	其中：债券	145,305,586.59	88.96
	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	1,543,420.45	0.94
8	其他各项资产	-	-
9	合计	163,336,919.45	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	19,742.40	0.01
B	采矿业	2,220,209.00	1.63
C	制造业	8,945,782.06	6.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	306,076.00	0.22
E	建筑业	319,338.00	0.23
F	批发和零售业	336,639.00	0.25
G	交通运输、仓储和邮政业	1,040,552.00	0.76
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	401,726.40	0.30
J	金融业	2,107,576.00	1.55
K	房地产业	12,870.00	0.01
L	租赁和商务服务业	346,292.00	0.25
M	科学研究和技术服务业	95,801.69	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	155,421.86	0.11
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	179,886.00	0.13
S	综合	-	-
	合计	16,487,912.41	12.11

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	300308	中际旭创	700	889,000.00	0.65
2	300502	新易盛	740	449,180.00	0.33
3	688012	中微公司	474	222,069.00	0.16
4	601988	中国银行	36,800	210,496.00	0.15
5	688008	澜起科技	676	209,492.40	0.15
6	688041	海光信息	565	209,219.50	0.15
7	605599	菜百股份	14,200	194,540.00	0.14
8	601939	建设银行	18,800	181,044.00	0.13
9	601899	紫金矿业	7,200	181,008.00	0.13
10	000408	藏格矿业	2,600	180,232.00	0.13
11	002371	北方华创	200	176,912.00	0.13
12	600150	中国船舶	4,900	165,571.00	0.12
13	601398	工商银行	23,100	163,317.00	0.12
14	601328	交通银行	24,600	158,178.00	0.12
15	601000	唐山港	37,400	155,210.00	0.11
16	002563	森马服饰	30,300	152,712.00	0.11
17	600971	恒源煤电	22,000	151,800.00	0.11
18	002763	汇洁股份	22,200	150,738.00	0.11
19	601166	兴业银行	9,100	150,696.00	0.11
20	600153	建发股份	19,000	150,670.00	0.11
21	601098	中南传媒	15,300	150,552.00	0.11
22	601919	中远海控	11,300	149,838.00	0.11

23	601998	中信银行	21,600	149,688.00	0.11
24	600256	广汇能源	30,300	149,682.00	0.11
25	600015	华夏银行	23,400	149,526.00	0.11
26	600502	安徽建工	34,100	148,335.00	0.11
27	600219	南山铝业	36,900	147,231.00	0.11
28	603565	中谷物流	15,000	147,150.00	0.11
29	601838	成都银行	8,300	146,910.00	0.11
30	600919	江苏银行	13,600	146,608.00	0.11
31	603706	东方环宇	8,400	145,236.00	0.11
32	601009	南京银行	14,600	144,394.00	0.11
33	000157	中联重科	20,500	142,885.00	0.10
34	600985	淮北矿业	10,000	140,500.00	0.10
35	601225	陕西煤业	6,700	136,345.00	0.10
36	600546	山煤国际	12,200	133,346.00	0.10
37	600348	华阳股份	17,400	133,110.00	0.10
38	600188	兖矿能源	6,900	122,613.00	0.09
39	600183	生益科技	700	121,380.00	0.09
40	002233	塔牌集团	17,400	121,278.00	0.09
41	000983	山西焦煤	20,900	121,220.00	0.09
42	601857	中国石油	13,900	120,652.00	0.09
43	002271	东方雨虹	10,100	119,887.00	0.09
44	688002	睿创微纳	774	119,730.06	0.09
45	002572	索菲亚	16,000	116,800.00	0.09
46	601088	中国神华	2,900	113,216.00	0.08
47	000596	古井贡酒	1,400	111,720.00	0.08
48	603993	洛阳钼业	6,300	110,565.00	0.08
49	603967	中创物流	10,400	107,640.00	0.08
50	688279	峰岬科技	477	107,057.88	0.08
51	601598	中国外运	21,300	105,648.00	0.08
52	600295	鄂尔多斯	9,700	103,984.00	0.08
53	300857	协创数据	300	101,970.00	0.07
54	601997	贵阳银行	19,700	101,061.00	0.07
55	000937	冀中能源	24,500	97,510.00	0.07
56	600012	皖通高速	6,100	96,136.00	0.07
57	002493	荣盛石化	8,900	95,675.00	0.07
58	601216	君正集团	20,900	93,214.00	0.07
59	002916	深南电路	200	91,580.00	0.07
60	301358	湖南裕能	1,200	91,044.00	0.07
61	000977	浪潮信息	1,300	91,000.00	0.07
62	600901	江苏金租	15,800	90,850.00	0.07
63	000651	格力电器	2,400	90,000.00	0.07
64	000415	渤海租赁	22,100	89,947.00	0.07
65	688275	万润新能	697	88,902.35	0.07

66	002028	思源电气	500	86,500.00	0.06
67	002653	海思科	1,300	86,242.00	0.06
68	000913	钱江摩托	8,400	86,100.00	0.06
69	300394	天孚通信	280	84,750.40	0.06
70	600026	中远海能	4,600	82,524.00	0.06
71	000426	兴业银锡	2,500	82,400.00	0.06
72	002266	浙富控股	16,000	80,960.00	0.06
73	688517	金冠电气	4,618	80,722.64	0.06
74	300274	阳光电源	500	79,510.00	0.06
75	601666	平煤股份	11,100	79,365.00	0.06
76	002379	宏桥控股	5,200	76,804.00	0.06
77	600329	达仁堂	2,000	74,440.00	0.05
78	002169	智光电气	5,000	73,200.00	0.05
79	002441	众业达	9,300	72,540.00	0.05
80	600039	四川路桥	9,200	71,944.00	0.05
81	301308	江波龙	100	70,380.00	0.05
82	301219	腾远钴业	1,280	70,144.00	0.05
83	601107	四川成渝	14,300	69,784.00	0.05
84	000605	渤海股份	13,000	69,550.00	0.05
85	601077	渝农商行	11,300	69,043.00	0.05
86	688220	翱捷科技	542	67,381.44	0.05
87	601288	农业银行	11,100	67,377.00	0.05
88	688378	奥来德	1,076	66,712.00	0.05
89	000725	京东方 A	7,600	65,968.00	0.05
90	688081	兴图新科	1,599	65,367.12	0.05
91	601886	江河集团	8,100	65,043.00	0.05
92	301536	星辰科技	500	64,355.00	0.05
93	601001	晋控煤业	3,600	62,604.00	0.05
94	688052	纳芯微	217	62,563.27	0.05
95	002947	恒铭达	800	60,840.00	0.04
96	002284	亚太股份	6,300	59,787.00	0.04
97	601229	上海银行	6,800	59,024.00	0.04
98	688737	中自科技	2,814	53,859.96	0.04
99	600177	雅戈尔	7,100	53,463.00	0.04
100	688155	先惠技术	651	52,659.39	0.04
101	688127	蓝特光学	532	51,923.20	0.04
102	000807	云铝股份	2,300	50,922.00	0.04
103	002544	普天科技	2,700	49,194.00	0.04
104	600816	建元信托	19,700	48,068.00	0.04
105	601233	桐昆股份	2,200	47,630.00	0.03
106	301280	珠城科技	940	47,535.80	0.03
107	002616	长青集团	10,500	46,935.00	0.03
108	600166	福田汽车	16,100	46,851.00	0.03

109	688518	联赢激光	1,510	46,659.00	0.03
110	688173	希荻微	2,425	46,414.50	0.03
111	688311	盟升电子	1,754	45,937.26	0.03
112	600066	宇通客车	1,700	45,577.00	0.03
113	688678	福立旺	1,860	44,956.20	0.03
114	600989	宝丰能源	2,200	44,726.00	0.03
115	688779	五矿新能	5,480	44,442.80	0.03
116	688981	中芯国际	279	44,310.78	0.03
117	688231	隆达股份	1,200	44,076.00	0.03
118	001337	四川黄金	1,200	43,992.00	0.03
119	600595	中孚实业	7,800	43,836.00	0.03
120	688309	恒誉环保	720	43,833.60	0.03
121	688683	莱尔科技	1,153	43,721.76	0.03
122	001298	好上好	2,100	43,575.00	0.03
123	001228	永泰运	1,700	43,435.00	0.03
124	600685	中船防务	1,700	43,248.00	0.03
125	301246	宏源药业	1,600	43,040.00	0.03
126	002800	天顺股份	3,300	42,867.00	0.03
127	301068	大地海洋	1,800	42,840.00	0.03
128	603507	振江股份	1,300	42,757.00	0.03
129	002134	天津普林	1,400	42,588.00	0.03
130	301169	零点有数	600	42,396.00	0.03
131	000301	东方盛虹	3,700	42,365.00	0.03
132	301295	美硕科技	1,000	42,180.00	0.03
133	605068	明新旭腾	2,500	41,950.00	0.03
134	301086	鸿富瀚	200	41,856.00	0.03
135	603268	松发股份	300	41,784.00	0.03
136	603296	华勤技术	560	41,591.20	0.03
137	300191	潜能恒信	1,500	41,475.00	0.03
138	601699	潞安环能	2,900	41,412.00	0.03
139	605338	巴比食品	2,300	41,170.00	0.03
140	002534	西子洁能	2,200	40,810.00	0.03
141	603312	西典新能	1,200	40,776.00	0.03
142	301024	霍普股份	1,100	40,502.00	0.03
143	300750	宁德时代	100	39,301.00	0.03
144	600312	平高电气	2,200	38,852.00	0.03
145	002154	报喜鸟	10,900	38,804.00	0.03
146	603615	茶花股份	2,400	38,760.00	0.03
147	688215	瑞晟智能	952	38,232.32	0.03
148	688230	芯导科技	484	38,144.04	0.03
149	603132	金徽股份	2,400	37,392.00	0.03
150	301057	汇隆新材	1,600	36,800.00	0.03
151	601717	中创智领	2,600	36,166.00	0.03

152	002919	名臣健康	1,900	36,081.00	0.03
153	600008	首创环保	13,200	35,904.00	0.03
154	601336	新华保险	600	35,796.00	0.03
155	688049	炬芯科技	763	35,792.33	0.03
156	600036	招商银行	1,000	35,500.00	0.03
157	688021	奥福科技	1,815	35,138.40	0.03
158	300919	中伟新材	800	35,000.00	0.03
159	600642	申能股份	4,000	34,920.00	0.03
160	300476	胜宏科技	100	34,643.00	0.03
161	688709	成都华微	884	33,671.56	0.02
162	301097	天益医疗	920	32,844.00	0.02
163	600331	宏达股份	2,800	30,772.00	0.02
164	301162	国能日新	700	30,625.00	0.02
165	002463	沪电股份	200	30,560.00	0.02
166	688203	海正生材	3,040	30,339.20	0.02
167	300270	中威电子	2,300	29,923.00	0.02
168	601168	西部矿业	1,100	29,854.00	0.02
169	688653	康希通信	1,652	28,711.76	0.02
170	002273	水晶光电	800	28,384.00	0.02
171	688679	通源环境	654	27,526.86	0.02
172	688718	唯赛勃	1,681	26,845.57	0.02
173	688618	三旺通信	859	26,431.43	0.02
174	002155	湖南黄金	1,100	26,257.00	0.02
175	603162	海通发展	2,900	26,013.00	0.02
176	002416	爱施德	2,900	25,984.00	0.02
177	601816	京沪高铁	5,600	25,368.00	0.02
178	688758	赛分科技	1,138	25,047.38	0.02
179	603068	博通集成	600	24,138.00	0.02
180	688578	艾力斯	220	24,024.00	0.02
181	000975	山金国际	1,400	23,800.00	0.02
182	300458	全志科技	600	23,676.00	0.02
183	688293	奥浦迈	548	22,846.12	0.02
184	301075	多瑞医药	400	22,804.00	0.02
185	301198	喜悦智行	1,700	22,780.00	0.02
186	301121	紫建电子	700	22,414.00	0.02
187	300478	杭州高新	600	22,014.00	0.02
188	603701	德宏股份	1,000	21,980.00	0.02
189	301105	鸿铭股份	500	21,490.00	0.02
190	603508	思维列控	1,000	21,360.00	0.02
191	301172	君逸数码	800	20,760.00	0.02
192	002259	升达林业	5,400	20,466.00	0.02
193	002716	湖南白银	2,500	20,225.00	0.01
194	688182	灿勤科技	466	20,070.62	0.01

195	300844	山水比德	900	19,989.00	0.01
196	002027	分众传媒	4,100	19,844.00	0.01
197	300970	华绿生物	1,080	19,742.40	0.01
198	601801	皖新传媒	4,000	19,720.00	0.01
199	301380	挖金客	700	19,313.00	0.01
200	688399	硕世生物	418	18,973.02	0.01
201	002850	科达利	100	18,930.00	0.01
202	688636	智明达	521	18,875.83	0.01
203	603893	瑞芯微	100	18,836.00	0.01
204	601333	广深铁路	6,800	18,700.00	0.01
205	603317	天味食品	1,400	18,214.00	0.01
206	001360	南矿集团	1,000	17,690.00	0.01
207	301189	奥尼电子	300	17,679.00	0.01
208	000951	中国重汽	900	17,559.00	0.01
209	300822	贝仕达克	1,500	17,550.00	0.01
210	002487	大金重工	300	17,391.00	0.01
211	002338	奥普光电	300	17,160.00	0.01
212	603909	建发合诚	2,000	17,060.00	0.01
213	300563	神宇股份	600	17,034.00	0.01
214	300517	海波重科	1,800	16,956.00	0.01
215	002451	摩恩电气	2,400	16,896.00	0.01
216	002316	亚联发展	4,000	16,240.00	0.01
217	300006	莱美药业	2,900	14,877.00	0.01
218	000603	盛达资源	600	13,860.00	0.01
219	601021	春秋航空	300	13,674.00	0.01
220	600938	中国海油	500	13,575.00	0.01
221	688568	中科星图	325	13,477.75	0.01
222	600566	济川药业	600	13,314.00	0.01
223	002460	赣锋锂业	200	13,080.00	0.01
224	300128	锦富技术	2,200	13,024.00	0.01
225	600773	西藏城投	1,000	12,870.00	0.01
226	601969	海南矿业	1,600	12,656.00	0.01
227	688621	阳光诺和	227	12,464.57	0.01
228	301606	绿联科技	200	12,204.00	0.01
229	603766	隆鑫通用	1,000	11,930.00	0.01
230	300837	浙矿股份	500	11,880.00	0.01
231	300393	中来股份	1,600	11,664.00	0.01
232	688469	芯联集成	1,054	11,182.94	0.01
233	301081	严牌股份	800	10,944.00	0.01
234	688075	安旭生物	355	10,564.80	0.01
235	605138	盛泰集团	1,900	10,488.00	0.01
236	301662	宏工科技	100	10,132.00	0.01
237	600961	株冶集团	300	9,717.00	0.01

238	001311	多利科技	600	9,678.00	0.01
239	300426	华智数媒	1,900	9,614.00	0.01
240	002633	申科股份	600	9,078.00	0.01
241	002049	紫光国微	100	8,875.00	0.01
242	002868	绿康生化	400	8,836.00	0.01
243	600273	嘉化能源	1,300	8,476.00	0.01
244	300530	领湃科技	500	8,425.00	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	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	300308	中际旭创	932,282.00	0.68
2	601899	紫金矿业	718,212.00	0.53
3	300502	新易盛	531,191.00	0.39
4	000408	藏格矿业	488,437.00	0.36
5	600188	兖矿能源	468,562.00	0.34
6	000937	冀中能源	423,018.00	0.31
7	600348	华阳股份	387,349.00	0.28
8	300476	胜宏科技	386,260.00	0.28
9	601101	昊华能源	378,571.00	0.28
10	601666	平煤股份	370,543.00	0.27
11	605599	菜百股份	358,157.00	0.26
12	601919	中远海控	350,399.00	0.26
13	600150	中国船舶	347,044.00	0.25
14	600039	四川路桥	341,135.00	0.25
15	688012	中微公司	332,713.72	0.24
16	002911	佛燃能源	327,899.00	0.24
17	601001	晋控煤业	326,283.00	0.24
18	601166	兴业银行	325,563.00	0.24
19	603296	华勤技术	322,019.00	0.24
20	601988	中国银行	321,532.00	0.24

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	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	300308	中际旭创	845,599.00	0.62
2	300502	新易盛	498,714.00	0.37
3	601101	昊华能源	471,599.00	0.35
4	300476	胜宏科技	383,956.00	0.28
5	601899	紫金矿业	356,420.00	0.26

6	600188	兖矿能源	327,712.00	0.24
7	601001	晋控煤业	308,350.00	0.23
8	603296	华勤技术	298,462.00	0.22
9	000672	上峰材料	290,859.00	0.21
10	688248	南网科技	289,662.15	0.21
11	000937	冀中能源	278,176.00	0.20
12	600183	生益科技	272,957.00	0.20
13	603889	新澳股份	270,513.00	0.20
14	688012	中微公司	267,023.20	0.20
15	000408	藏格矿业	255,037.00	0.19
16	002911	佛燃能源	249,798.00	0.18
17	600057	厦门象屿	247,063.00	0.18
18	601288	农业银行	246,835.00	0.18
19	601666	平煤股份	243,834.00	0.18
20	600067	冠城新材	238,992.00	0.18

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	63,361,968.11
卖出股票收入（成交）总额	46,834,406.84

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	9,847,834.25	7.24
2	央行票据	-	-
3	金融债券	73,966,104.66	54.34
	其中：政策性金融债	21,353,512.33	15.69
4	企业债券	10,134,526.03	7.45
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	51,357,121.65	37.73
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	145,305,586.59	106.76

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 （张）	公允价值	占基金资产净值比例 （%）
----	------	------	-----------	------	------------------

1	232380074	23 农行二级 资本债 03B	100,000	11,271,073.97	8.28
2	210215	21 国开 15	100,000	11,017,745.21	8.09
3	232480007	24 建行二级 资本债 01B	100,000	10,659,240.00	7.83
4	102485101	24 中国环保 MTN001	100,000	10,399,974.25	7.64
5	102485180	24 陕西交通 MTN009	100,000	10,399,100.82	7.64

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

为有效控制债券投资的系统性风险，本基金将结合对宏观经济形势和证券趋势的判断，通过对债券市场进行定性和定量的分析，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货来提高投资组合的运作效率。在国债期货投资过程中，本基金将对国债期货和现货基差、国债期货的流动性水平等指标进行跟踪监控。

7.10.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内没有投资国债期货。

7.11 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行、国家外汇管理局北京市分局的处罚，中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚，中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行、国家金融监督管理总局的处罚，徽商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行安徽省分行、国家金融监督管理总局安徽监管局的处罚。本基金投资的前十名证券中，上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查、或

在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.11.2 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未超出基金合同约定的备选股票库。

7.11.3 期末其他各项资产构成

本基金本报告期末未持有其他资产。

7.11.4 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。

7.11.5 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。

7.11.6 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（%）
路博迈添航债券 A	490	275,229.35	-	-	134,862,381.03	100.0000
路博迈添航债券 C	26	8,112.37	-	-	210,921.65	100.0000
合计	511	264,331.32	-	-	135,073,302.68	100.0000

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

8.2 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	路博迈添航债券 A	549,924.74	0.4078

所有从业人员持有本基金	路博迈添航债券 C	-	-
	合计	549,924.74	0.4071

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

8.3 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	路博迈添航债券 A	50~100
	路博迈添航债券 C	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	路博迈添航债券 A	0~10
	路博迈添航债券 C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	路博迈添航债券 A	路博迈添航债券 C
基金合同生效日（2026 年 02 月 11 日）基金份额总额	261,896,948.91	375,344.47
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,179,415.10	1,254.64
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	128,213,982.98	165,677.46
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	134,862,381.03	210,921.65

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

报告期内管理人无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人托管业务部门未受到调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚。

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 (%)	
兴业证券	2	110,196,374	100.00	62,166.94	100.00	-

		. 95				
--	--	------	--	--	--	--

注：1、交易单元的选择标准：

- (1)公司实力雄厚，信誉良好；
- (2)公司研究实力较强，研究机构和专门的研究人员能为基金提供高质量的资讯服务, 包括宏观经济报告、行业报告、市场分析、个股分析报告、市场数据统计及其它专门报告等, 并能根据基金投资的特定要求, 提供专门研究报告；
- (3)公司财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (4)公司经营行为规范，内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5)公司具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，可以为公司开展交易提供必要的交易终端，若交易终端无法满足基金产品正常交易需求的，可在确保合规与风险可控的前提下接入公司的信息系统, 并能为基金提供全面的信息服务。

2、交易单元的选择流程：

各相关部门按照研究能力、运营能力、交易服务和合规情况对拟进行合作的证券公司进行打分后建立白名单，在白名单中选定合作的证券公司。

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	
	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 (%)
兴业证券	300, 510, 951. 08	100. 00	1, 542, 330, 000. 00	100. 00	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	路博迈添航债券型证券投资基金（A类份额）基金产品资料概要	中国证监会规定媒介	2026-01-29
2	路博迈添航债券型证券投资基金（C类份额）基金产品资料概要	中国证监会规定媒介	2026-01-29
3	路博迈添航债券型证券投资基金份额发售公告	中国证监会规定媒介	2026-01-29
4	路博迈添航债券型证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒介	2026-01-29
5	路博迈添航债券型证券投资基金托	中国证监会规定媒介	2026-01-29

	管协议		
6	路博迈添航债券型证券投资基金招募说明书	中国证监会规定媒介	2026-01-29
7	关于路博迈添航债券型证券投资基金提前结束募集的公告	中国证监会规定媒介	2026-02-07
8	路博迈添航债券型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会规定媒介	2026-02-12
9	路博迈添航债券型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2026-03-11
10	路博迈基金管理（中国）有限公司关于旗下部分基金新增易方达财富管理基金销售（广州）有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2026-03-13
11	路博迈基金管理（中国）有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	中国证监会规定媒介	2026-03-30
12	路博迈基金管理（中国）有限公司关于旗下部分基金新增华宝证券股份有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2026-04-23
13	2025 年度路博迈基金管理（中国）有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	中国证监会规定媒介	2026-04-24
14	路博迈基金管理（中国）有限公司关于旗下部分基金新增汇添富基金销售（上海）有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2026-06-23

§ 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

本基金本报告期内未发生单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告截止日至报告送出日之间，基金管理人发生如下高级管理人员变动：基金管理人于 2026 年 8 月 1 日发布《路博迈基金管理（中国）有限公司关于高级管理人员变更的公告》，自 2026 年 7 月 30 日起，刘铮女士担任公司督察长，林海中先生因个人原因不再担任公司督察长。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准募集本基金的文件
- 2、本基金的基金合同
- 3、本基金的托管协议
- 4、本基金的招募说明书
- 5、本基金的各项公告
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 7、法律法规及中国证监会规定的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人的办公场所：上海市静安区石门一路 288 号香港兴业中心二座 7 楼 705-710 室

12.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人路博迈基金管理（中国）有限公司。

咨询电话：400-875-5888

公司网址：www.nbchina.com

路博迈基金管理（中国）有限公司

2026 年 8 月 28 日