

贝莱德富元金利混合型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：贝莱德基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 2 月 10 日（基金合同生效日）起至 06 月 30 日止。

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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
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	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
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	53
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	54
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	54

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	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12 投资组合报告附注	55
§ 8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
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	56
§ 9 开放式基金份额变动	56
§ 10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
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	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4 基金投资策略的改变	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	57
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	58
10.8 其他重大事件	59
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	59
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	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	60
§ 12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	贝莱德富元金利混合型证券投资基金	
基金简称	贝莱德富元金利混合	
基金主代码	026529	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2026 年 2 月 10 日	
基金管理人	贝莱德基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	188,822,218.50 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	贝莱德富元金利混合 A	贝莱德富元金利混合 C
下属分级基金的交 易代码	026529	026530
报告期末下属分级 基金的份额总额	124,730,433.64 份	64,091,784.86 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金运用量化投资信号驱动多资产分散配置，辅以基金经理对于模型以外风险的主观判断，通过捕获大类资产的长期风险溢价，管控波动以及下行风险，力争实现组合长期稳健的增值。
投资策略	1、 资产配置策略 本基金将采用公司自主研发的量化模型对各类资产相对价值及市场长期风险溢价进行判断，动态把握不同资产类别的投资价值、投资时机以及其风险收益特征的相对变化，并通过“自上而下”的分析方法综合评估和持续跟踪基本面、政策面、市场面等多方面因素，结合全球宏观经济形势，研判国内外经济的发展趋势，并在严格控制投资组合风险的前提下，对组合中债券、股票、基金、金融衍生品、货币市场工具的投资比例进行战略配置和战术调整，以分散市场风险，力争实现基金净值的中长期稳健增值。对于量化模型关注不到的或有风险，基金经理将提供主观裁量以辅助模型在资产类别以及行业层面风险敞口的确定和修正。 本基金将根据模型量化指标，以在债券、股票、基金以及现金等各类资产间灵活调整仓位的方式，力求实现组合波动率控制以及最大回撤控制等投资目标。因此，在市场大幅波动（上行或者下行）或者组合大幅回撤的情况下，本基金或将显著下调组合风险敞口并增加现金类资产的持仓；当市场波动降低、组合回撤得到控制时，本基金或将再次扩大组合风险敞口，以期实现最终的投资目标。 2、 债券投资策略 3、 股票投资策略 4、 金融衍生品投资策略 5、 基金投资策略

	6、参与融资业务策略
业绩比较基准	中债-新综合财富（总值）指数收益率×77%+中证 800 指数收益率×15%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×3%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，在通常情况下其预期风险和收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。 本基金如果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		贝莱德基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	谢超	王小飞
	联系电话	021-80225188	021-60637103
	电子邮箱	Compliance_FMC@blackrock.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-002-6655	021-60637228
传真		021-80225288	021-60635778
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 7 楼 702 室	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 7 楼 702 室	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		郁蓓华	张金良

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.blackrock.com.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国建设银行股份有限公司	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

§ 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	2026 年 2 月 10 日（基金合同生效日） - 2026 年 6 月 30 日	
据和指标	贝莱德富元金利混合 A	贝莱德富元金利混合 C
本期已实现收益	1,645,431.12	958,353.62
本期利润	3,036,846.88	2,344,958.66

加权平均基金份额本期利润	0.0151	0.0139
本期加权平均净值利润率	1.51%	1.39%
本期基金份额净值增长率	1.95%	1.80%
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	1,288,764.03	562,654.54
期末可供分配基金份额利润	0.0103	0.0088
期末基金资产净值	127,165,332.56	65,242,441.39
期末基金份额净值	1.0195	1.0180
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	1.95%	1.80%

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

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

3、期末可供分配利润，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、表中的“期末”指报告期最后一日，即 2026 年 6 月 30 日；“本期”指 2026 年 2 月 10 日（基金合同生效日）– 2026 年 6 月 30 日。

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

贝莱德富元金利混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

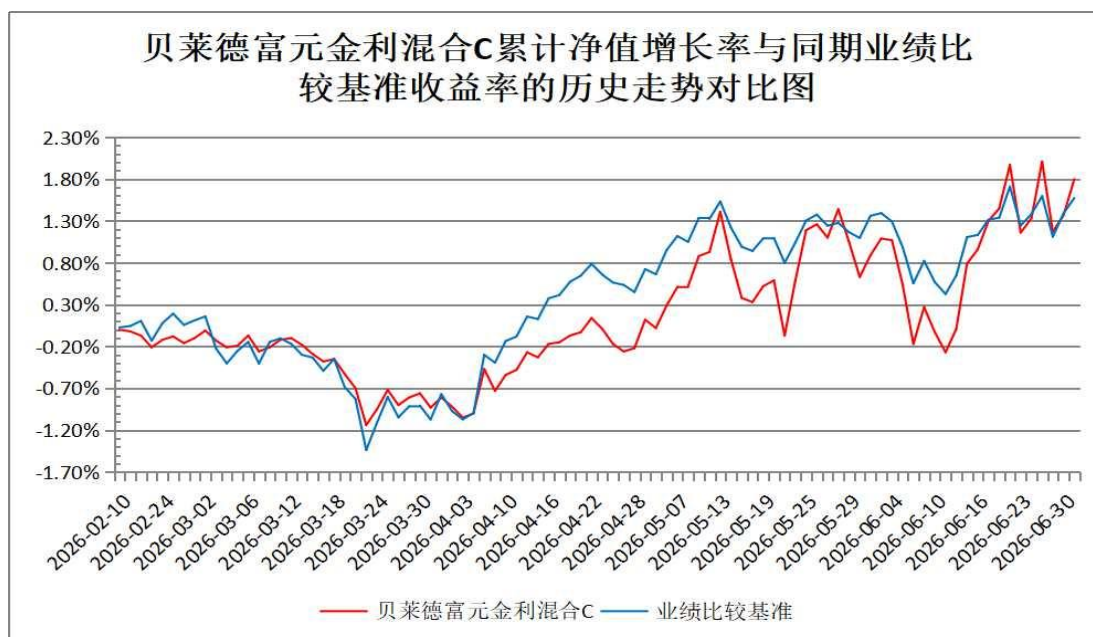
过去三个月	2.84%	0.36%	2.68%	0.23%	0.16%	0.13%
自基金合同生效 日起至今	1.95%	0.31%	1.57%	0.23%	0.38%	0.08%

贝莱德富元金利混合 C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基准 收益率标准 差④	①—③	②—④
过去三个月	2.76%	0.36%	2.68%	0.23%	0.08%	0.13%
自基金合同生效 日起至今	1.80%	0.31%	1.57%	0.23%	0.23%	0.08%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





注：1、本基金的基金合同于 2026 年 02 月 10 日生效，自合同生效日起至本报告期末不满一年。

2、按基金合同规定，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

贝莱德基金管理有限公司成立于 2020 年 9 月 10 日，是国内首家外资全资控股的公募基金管理机构。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准设立贝莱德基金管理有限公司的批复》（证监许可[2020]1917 号）批准，由贝莱德金融管理公司（BlackRock Financial Management, Inc.）出资成立。截至报告期末，公司旗下发行并管理了 19 只公开募集证券投资基金：贝莱德中国新视野混合型证券投资基金、贝莱德港股通远景视野混合型证券投资基金、贝莱德先进制造一年持有期混合型证券投资基金、贝莱德浦悦丰利混合型证券投资基金、贝莱德欣悦丰利债券型证券投资基金、贝莱德行业优选混合型证券投资基金、贝莱德安睿 30 天持有期债券型证券投资基金、贝莱德卓越远航混合型证券投资基金、贝莱德中债 0-3 年政策性金融债指数证券投资基金、贝莱德安裕 90 天持有期债券型证券投资基金、贝莱德沪深 300 指数增强型证券投资基金、贝莱德中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、贝莱德和悦利率债债券型证券投资基金、贝莱德中证 A500 指数增强型证券投资基金、贝莱德富元添益债券型证券投资基金、贝莱德安泽 60 天持有期债券型证券投资基金、贝莱德中债投资优选绿色债券指数证券投资基金、贝莱德中证 500 指数增强型证券投资基金、贝莱德富元金利混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王晓京	本基金的基金经理，首席权益、多资产及指数投资官	2026 年 2 月 10 日		15 年	王晓京先生，首席权益、多资产及指数投资官，基金经理，曾受雇于贝莱德英国（BlackRock Investment Management (UK) Limited）以及贝莱德建信理财有限责任公司，历任研究员、基金经理等职务。加入贝莱德之前，王晓京先生曾就职于花旗银行（伦敦），任投资银行部分析员。王晓京先生是特许金融分析师（CFA）持证人，拥有清华大学电子信息工程学士学位、英国伯明翰大学电气工程硕士学位、伦敦大学电子工程博士学位。
陈之渊	本基金的基金经理	2026 年 2 月 10 日		10 年	陈之渊先生，基金经理，曾于贝莱德建信理财有限责任公司担任投资经理。加入贝莱德之前，曾任香港千禧年基金（Millennium Capital Management (Hong Kong) Limited）量化研究员和量化交易员，花旗银行（香港）大中华区宏观交易员。陈之渊拥有卡内基梅隆大学计算金融硕士学位以及香港大学经济与金融学学士学位。

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

2、证券从业的含义遵从《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》及行业协会的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

本基金管理人在本报告期内遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金基金合同的约定，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。本报告期内，本基金无重大违法、违规行为，本基金投资运作符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有投资组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，

通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部相关公平交易制度等规定。

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。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾上半年权益市场的表现，指数开年延续了春季躁动后陷入震荡，市场在等待政策及更多经济数据确认的过程中年初的涨幅被部分消化。随后由于中东冲突的爆发，投资者风险偏好剧烈收缩，全球权益资产不同程度受挫，A股市场也经历了较为剧烈的风格切换。4月停火协议初步达成以来，地缘冲突的局势有所缓和，全球风险资产、尤其A股市场的情绪重新升温。在海外映射、产业趋势催化及盈利确定性等多重因素共振下，二季度权益市场进入了科技类行业大幅引领其他行业的结构性牛市态势。市场风格也展现出了强劲的大盘成长偏向，资产间的表现分化显著，其中科创50指数表现亮眼，而中证红利指数仅二季度出现了双位数回撤。本基金在二月中旬成立，股票策略在成立后一周内便开始建仓，在四月初中东地缘危机有缓和迹象后本基金快速加仓整体权益资产至超配，并且在四月下旬至五月上旬进一步调整动量信号使得其更好地适配当时的权益市场风格。六月初由于强劲的海外经济数据使得美联储加息预期骤升，导致前期涨幅较大的风险资产出现了较为明显的快速下跌，本基金也降低了权益整体仓位。在此期间行业轮动模型表现正常，符合策略预期。

债券市场方面，中国利率市场整体呈现震荡下行的走势，收益率曲线走陡。年初央行维持适度宽松的货币政策，一月央行进行结构性降息 - 下调再贷款、再贴现利率 0.25 个百分点，并在二月春节期间通过买断式逆回购和 MLF 操作来呵护资金面平稳。随着中东冲突的爆发，地缘波动造成油价快速上升并传导至通胀层面，造成国内 PPI 有所爬升，CPI 则维持在 1%附近。在上半年出口强劲的拉动下，经济增速维持，央行虽然后续未进一步降准降息，但通过 7 天逆回购、买断式逆回购、中期借贷便利等工具确保资金面充沛，流动性未受季末等季节性阶段性扰动而紧张。从五月下旬开始，资金面出现边际收紧。本基金成立后初期在各类账户完全开立之前处于以现金管理为主的阶段，后按建仓节奏进入到以利率债和高等级金融债为主要配置的阶段，目前已进入正常运作区间，固收部分成立以来对组合收益的整体贡献相对有限。

产品运作层面，截至 2026 年 6 月 30 日，本基金上半年取得了收益率 1.95% (A 类) 以及 1.80%

(C 类)。截至二季度末,本基金成立以来最大回撤为-167bps (A 类)以及-169bps (C 类),整体组合波动符合模型预期。我们将继续坚持严格的多资产模型化投资方法论和风险控制机制,力争在控制组合波动与回撤的基础上为投资者获取相对稳定的回报。

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 1.0195 元,本报告期内净值增长率 1.95%,同期业绩比较基准收益率 1.57%。截至本报告期末,本基金 C 类份额净值 1.0180 元,本报告期内净值增长率 1.80%,同期业绩比较基准收益率 1.57%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

后市我们仍坚持看好中国资产的观点不变,核心原因如下:

一、宏观经济韧性十足,中国经济在复杂的地缘政治格局和国际油价波动中展现出超预期的抗压能力,未过多受外部冲击拖累。从增长动能来看,出口保持韧性,制造业投资维持高位,为整体经济提供了坚实支撑。上市公司盈利也正式进入兑现阶段:一季度全 A 整体盈利同比增长 7% 左右,进入二季度,尽管完整财报尚未披露,但目前已公布的业绩预告和先行指标均指向盈利将进一步改善,市场一致预期二季度同比增速有望继续上行。

二、中国在科技和高端制造业具备全球优势。AI 领域中美是全球少数在五层分类上均有显著布局的国家,中国科技企业有望在成本、技术和商业模式上以综合实力参与全球竞争,部分半导体和发电储能企业基于蓝海定位和高门槛,基本面持续向好。近期海内外科技板块短期表现有所波动,但拉长至 24-36 个月维度,我们认为科技的牛市并未结束。全球科技股动量回调源于前期拥挤度过高和部分市场杠杆过高,而非头部公司基本面减速。AI 需求仍在指数级上升,浪潮刚刚兴起,优质资产近期回调后估值吸引力进一步增强,配置价值显现。

三、我们注意到,近年来 A 股市场在投资者回报机制方面发生了积极的结构性变化,分红率持续提升是最直观的体现。投资者回报和对投资者的保护均有实质性提升,这为中长期资金入市创造了更友好的制度环境。叠加估值层面,无论是和近十年的历史相比还是横向对比其他市场,大中盘股票均有吸引力,共同支撑我们对市场的看好。

四、我们关注出口高增速掩盖的投资和内需的弱复苏,以及政策面或有的刺激投资和内需的措施。目前市场对此期待值不高,若出台强有力的刺激内需政策,泛消费类股票可能迎来修复性机会,比如现金流充沛的一些服务行业目前估值处于相对较低水平。

五、对于债券市场我们对利率债到期收益率曲线维持稳定看法,不追求整体平移的方向性,在各个关键久期以量化信号为工具进行有限度的低频择时波段操作。在信用债领域我们关注短久期高资质的品种。

六、我们持续关注地缘波动带来的输入性通胀/通胀预期及 AI 潮流带来的生产力提升，对全球经济以及各经济体货币/财政政策的影响。在中国资产端我们关注到韧性和安全性溢价，会继续关注中长期对国内物价及生产效率的影响，以及对中长期政策决策轨迹和各类资产定价的潜在影响。

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查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。

§ 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： 贝莱德富元金利混合型证券投资基金

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	1,762,599.48
结算备付金		7,026,068.22
存出保证金		398,125.00
交易性金融资产	6.4.7.2	181,956,022.81
其中：股票投资		57,146,672.82
基金投资		—
债券投资		124,809,349.99
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	3,000,030.00
债权投资		—
其中：债券投资		—
资产支持证券投资		—
其他投资		—
其他债权投资		—
其他权益工具投资		—
应收清算款		—
应收股利		—
应收申购款		8,987.36
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.5	62,277.14
资产总计		194,214,110.01
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		1,600,589.34

应付管理人报酬		115,674.76
应付托管费		28,918.67
应付销售服务费		30,239.26
应付投资顾问费		-
应交税费		6,354.17
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	24,559.86
负债合计		1,806,336.06
净资产:		
实收基金	6.4.7.7	188,822,218.50
其他综合收益		-
未分配利润	6.4.7.8	3,585,555.45
净资产合计		192,407,773.95
负债和净资产总计		194,214,110.01

注：1、报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 188,822,218.50 份，其中 A 类基金份额净值 1.0195 元，基金份额 124,730,433.64 份；C 类基金份额净值 1.0180 元，基金份额 64,091,784.86 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2026 年 2 月 10 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日止期间，无上年度可比数据。

6.2 利润表

会计主体：贝莱德富元金利混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 2 月 10 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 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		6,796,737.89
1. 利息收入		826,948.48
其中：存款利息收入	6.4.7.9	301,281.16
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		525,667.32
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,752,861.48
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-1,707,127.77
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	1,243,632.26
资产支持证券投资收益		-

贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.12	1,885,290.51
股利收益	6.4.7.13	331,066.48
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	2,778,020.80
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	1,438,907.13
减：二、营业总支出		1,414,932.35
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	859,740.02
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	214,934.96
3. 销售服务费		261,668.11
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失		-
7. 税金及附加		10,313.79
8. 其他费用	6.4.7.16	68,275.47
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,381,805.54
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,381,805.54
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		5,381,805.54

6.3 净资产变动表

会计主体：贝莱德富元金利混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 2 月 10 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 10 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	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更	-	-	-	-

正				
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	471,344,336.29	-	-	471,344,336.29
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	- 282,522,117.79	-	3,585,555.45	-278,936,562.34
(一)、综合收益总额	-	-	5,381,805.54	5,381,805.54
(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)	- 282,522,117.79	-	-1,796,250.09	-284,318,367.88
其中：1. 基金申购款	2,275,954.41	-	13,975.87	2,289,930.28
2. 基金赎回款	- 284,798,072.20	-	-1,810,225.96	-286,608,298.16
(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)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	188,822,218.50	-	3,585,555.45	192,407,773.95

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>郁蓓华</u>	<u>杨怡</u>	<u>徐菱莲</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

贝莱德富元金利混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2025]2819 号《关于准予贝莱德富元金利混合型证券投资基金注册

的批复》准予注册，由贝莱德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《贝莱德富元金利混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，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 471,229,701.15 元，业经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)德师报(验)字(26)第 00053 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《贝莱德富元金利混合型证券投资基金基金合同》于 2026 年 2 月 10 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 471,344,336.29 份基金份额，其中认购资金利息折合 114,635.14 份基金份额。本基金的基金管理人为贝莱德基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《贝莱德富元金利混合型证券投资基金基金合同》和《贝莱德富元金利混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。其中：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，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额，投资人通过直销机构认购/申购 A 类基金份额时不收取认购/申购费用；从直销机构以外的其他销售机构保有的本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购、申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 C 类基金份额。其中，对于投资人通过直销机构认购/申购的或者通过其他销售机构认购/申购且持续持有期限超过一年（即 365 天）的 C 类基金份额，计提的销售服务费将在投资人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人。本基金 A 类和 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基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《贝莱德富元金利混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板、科创板及其他中国证监会允许上市的股票、存托凭证)、港股通标的股票、债券(国债、金融债、企业债、公司债、政府支持债券、政府支持机构债券、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、可交换债券、次级债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、金融衍生品(包括国债期货、股指期货、股票期权、信用衍生品等)、经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金(仅包括全市场的股票型 ETF 和本基金基金管理人旗下的权益类基金，不包括 QDII 基金、香港互认基金、基金中基金、其他可投资公募基金的非基金中基金、货币市场基金)、债券回购、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、同业存单、现金等货币市场工具，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中

国证监会相关规定)。本基金所指的权益类基金包括股票型基金、基金合同约定股票(含存托凭证)资产投资比例不低于基金资产 60%的混合型基金,以及最近四个季度定期报告中披露的股票(含存托凭证)资产占基金资产比例均不低于 60%的混合型基金。本基金可根据法律法规的规定参与融资业务。基金的投资组合比例为:本基金对股票(含存托凭证)、权益类基金、可转换债券(含可分离交易可转债)及可交换债券的投资比例合计为基金资产的 10%-30%,其中投资于境内股票资产(含 A 股股票型 ETF)的比例合计不低于基金资产的 10%,投资于港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-50%;本基金持有其他基金,其市值不超过基金资产净值的 10%;每个交易日日终在扣除国债期货合约、股指期货合约和股票期权合约所需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准:中债-新综合财富(总值)指数收益率 $\times$ 77%+中证 800 指数收益率 $\times$ 15%+中证港股通综合指数(人民币)收益率 $\times$ 3%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

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”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年上半年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

本基金的会计年度为公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2026 年 02 月 10 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

本基金以人民币为记账本位币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

根据本基金的业务模式和现金流量特征,本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允

价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分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。

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，且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，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件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。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

(2) 金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂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。其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金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。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，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的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。

信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在上一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然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，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若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风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

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。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是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；第二层次输入值是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；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值原则如下：

(1) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，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) 当投资品种不存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，

且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数；

(3) 经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整，确定公允价值。

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，且目前可执行该种法定权利，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基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。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

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占净资产的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

(2) 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

基金投资收益于卖出基金成交日确认，并按卖出基金成交金额扣除应结转的基金投资成本、相关交易费用与税费后的差额入账。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本、相关交易费用与税费后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

(3) 公允价值变动收益 公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

(4) 信用减值损失 本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

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或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)在回购期内逐日计提。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为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；

(3) 基金收益分配后各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每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 同一类别内每一基金份额享有同等分配权；

(5) 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。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，与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

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

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

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、债券投资和基金投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

- (1) 对于基金投资，根据中基协发[2017]3 号《关于发布〈基金中基金估值业务指引（试行）〉的通知》之附件《基金中基金估值业务指引（试行）》的规定在估值日对非上市基金和上市基金进行估值；
- (2) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、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，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《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》(中基协发[2017]6 号),在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

(3)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,根据《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》(中国证监会公告[2017]13 号)及《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》(中基协发[2013]13 号)相关规定,本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(4)对于中国证券投资基金业协会《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》(中基协字[2022]566 号)所规定的固定收益品种,本基金按照相关规定,对以公允价值计量的固定收益品种选取第三方估值基准服务机构提供估值全价进行估值;对以摊余成本计量的固定收益品种用第三方估值基准服务机构提供的预期信用损失减值计量结果。

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

本基金本报告期无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日上海证券交易所发布的《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所发布的《关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2021]33 号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财税[2024]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》、国务院令 第 826 号《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》、财税[2026]12 号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 对公募证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；2027 年 12 月 31 日前，公开募集证券投资基金管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

(2) 对证券投资基金取得的自 2025 年 8 月 8 日之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复缴纳增值税；取得的在 2025 年 8 月 8 日之前已发行的国债、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。

(3) 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。

(4) 对证券投资基金取得的股票股息红利所得，由上市公司代扣代缴个人所得税；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，股息红利所得暂免征收个人所得税。其中，对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股，解禁后取得的股息红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。对基金通过港股通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过港股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。

(5) 对于证券投资基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税；自 2023 年 8 月 28 日起，出让方减按 0.05% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税。对于基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	708,096.44
等于：本金	707,714.42
加：应计利息	382.02
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	1,054,503.04
等于：本金	1,054,502.73
加：应计利息	0.31
减：坏账准备	-
合计	1,762,599.48

注：其他存款为存放在证券经纪商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		54,566,759.77	-	57,146,672.82	2,579,913.05
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	12,036,303.21	106,953.69	12,205,653.69	62,396.79
	银行间市场	111,405,333.57	1,134,696.30	112,603,696.30	63,666.43
	合计	123,441,636.78	1,241,649.99	124,809,349.99	126,063.22
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		178,008,396.55	1,241,649.99	181,956,022.81	2,705,976.27

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	11,300,526.04	-	-	-
其中： 国债期货	11,300,526.04	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其中： 股指期货	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	11,300,526.04	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
TL2609	TL2609	10.00	11,375,000.00	74,473.96
合计				74,473.96
减：可抵销期货暂收款				74,473.96
净额				-

注：1、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

2、衍生金融资产项下的利率\权益衍生工具为国债\股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持国债\股指期货投资合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的国债\股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购

交易所市场	3,000,030.00	—
银行间市场	—	—
合计	3,000,030.00	—

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应收利息	—
其他应收款	—
待摊费用	62,277.14
其他	—
合计	62,277.14

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	3,675.00
其中：交易所市场	—
银行间市场	3,675.00
应付利息	—
预提费用	18,394.86
其他	2,490.00
合计	24,559.86

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

贝莱德富元金利混合 A

项目	本期 2026 年 2 月 10 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	254,048,977.68	254,048,977.68
本期申购	1,203,665.55	1,203,665.55
本期赎回（以“-”号填列）	-130,522,209.59	-130,522,209.59
本期末	124,730,433.64	124,730,433.64

贝莱德富元金利混合 C

项目	本期 2026 年 2 月 10 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	217,295,358.61	217,295,358.61
本期申购	1,072,288.86	1,072,288.86
本期赎回（以“-”号填列）	-154,275,862.61	-154,275,862.61
本期末	64,091,784.86	64,091,784.86

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 2 月 10 日生效。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 471,229,701.15 元，折合基金份额 471,229,701.15 份；募集资金在募集期间产生的活期存款利息为人民币 114,635.14 元，折合基金份额 114,635.14 份；以上收到的实收基金（本息）共计人民币 471,344,336.29 元，折合基金份额 471,344,336.29 份。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

贝莱德富元金利混合 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	1,645,431.12	1,391,415.76	3,036,846.88
本期基金份额交易产生的变动数	-356,667.09	-245,280.87	-601,947.96
其中：基金申购款	5,716.52	772.65	6,489.17
基金赎回款	-362,383.61	-246,053.52	-608,437.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,288,764.03	1,146,134.89	2,434,898.92

贝莱德富元金利混合 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	958,353.62	1,386,605.04	2,344,958.66
本期基金份额交易产生的变动数	-395,699.08	-798,603.05	-1,194,302.13
其中：基金申购款	3,779.32	3,707.38	7,486.70
基金赎回款	-399,478.40	-802,310.43	-1,201,788.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	562,654.54	588,001.99	1,150,656.53

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	8,784.70
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	6,113.36
结算备付金利息收入	285,716.35
其他	666.75
合计	301,281.16

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商的证券交易结算资金的利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2026年2月10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	-1,707,127.77
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	-1,707,127.77

6.4.7.10.2 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 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	124,309,560.85
减：卖出股票成本总额	125,792,942.71
减：交易费用	223,745.91
买卖股票差价收入	-1,707,127.77

6.4.7.10.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益-证券出借差价收入。

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10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	1,042,635.94
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	200,996.32
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	1,243,632.26

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10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	204,090,386.72
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	202,705,624.76
减：应计利息总额	1,176,909.44
减：交易费用	6,856.20
买卖债券差价收入	200,996.32

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投资收益-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投资收益-申购差价收入。

6.4.7.12 衍生工具收益

6.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

6.4.7.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年2月10日（基金合同生效日）至2026年6月30日
国债期货投资收益	262,369.80
股指期货投资收益	1,622,920.71

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年2月10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	331,066.48
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	331,066.48

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	2,705,976.27
股票投资	2,579,913.05
债券投资	126,063.22
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	74,473.96
权证投资	-
股指期货	74,473.96
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动 产生的预估增值税	2,429.43
合计	2,778,020.80

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,438,416.94
基金转换费收入	490.19
合计	1,438,907.13

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 50% 归入基金资产。

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	18,394.86
信息披露费	47,722.86
证券出借违约金	-
存托服务费	9.07
证券组合费	11.28
汇划手续费	2,137.40

合计	68,275.47
----	-----------

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、注册登记机构、基金代销机构
贝莱德基金管理有限公司（“贝莱德基金”）	基金管理人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内无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

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

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 10 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	859,740.02
其中：应支付销售机构的客户维护费	387,315.20
应支付基金管理人的净管理费	472,424.82

注：本基金投资于本基金基金管理人所管理的公开募集证券投资基金的部分不收取管理费。支付基金管理人贝莱德基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值扣除所持有本基金基金管理人管理的其他公开募集证券投资基金的基金份额的资产净值后的余额(若为负数，则取 0)的 0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值扣除所持有本基金基金管理人管理的其他公开募集证券投资基金的基金份额的资产净值后的余额(若为负数，则取 0)×0.60%÷当年天数。支付销售机构的客户维护费不因投资于基金管理人管理的其他基金而调减，因此可能导致应支付基金管理人的净管理费为负。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 2 月 10 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	214,934.96

注：本基金投资于本基金托管人所托管的其他基金部分不收取托管费。支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人托管的其他公开募集证券投资基金的基金份额的资产净值后的余额(若为负数，则取 0)的 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人托管的其他公开募集证券投资基金的基金份额的资产净值后的余额(若为负数，则取 0)×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 10 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		
	贝莱德富元金利混合 A	贝莱德富元金利混合 C	合计
中国建设银行	-	242,734.26	242,734.26
合计	-	242,734.26	242,734.26

注：本基金实行销售服务费分级收费方式，分设 A、C 两类基金份额。本基金 A 类基金份额不收取

销售服务费；C 类基金的销售服务费按前一日 C 类基金份额对应的资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日销售服务费=前一日 C 类基金份额对应的资产净值×0.40%÷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

本基金本报告期内无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

本基金本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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 10 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
中国建设银行	708,096.44	8,784.70

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率或协议利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未发生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

6.4.10.8.1 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/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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的股票。

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

本基金本报告期末无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。

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因参与转融通证券出借业务而出借的证券。

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

本基金为混合型基金，其预期风险和收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

本基金如果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。本基金主要投资于依法发行上市的股票、港股通标的股票、债券等金融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。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。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建立，建立了由董事会、公司管理层、风险管理部门和业务职能部门构成的四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。董事会对风险管理的责任包括制定业务战略和风险管理目标、审阅重大事件和决策的风险评估等；管理层负责风险管理政策、风险控制措施的制定和落实，确保有效管理所有重大风险，下设风险管理委员会，根据董事会和管理层的授权开展风险管理工作；风险管理部门负责风险评估、报告、监控和管理，主要职责包括制定公司风险管理制度和程序、实施定量和定性的风险评估等；业务职能部门从经营管理的各业务环节上贯彻落实风险管理措施。在业务操作层面，各部门积极配合风险

管理部门完成运作风险管理，其他中后台部门包括但不限于财务、合规稽核和运营等部门在各自职能范围内支持或监督公司风险管理。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要通过定性和定量相结合的分析方法去评估各种相关风险可能造成的影响。从定性分析的角度触发，判断风险的种类、风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度触发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用的金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型和日常风险报告等，确定基金资产的风险状态及其是否符合基金的风险特征，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券发行人出现违约、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。

本基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用评级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算，对手为中国证券登记结算有限责任公司；在银行间同业市场根据交易类型采取白名单和黑名单相结合的方式防范交易对手风险。

于本报告期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的固定收益品种占基金资产净值的比例为 32.35%。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金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	62,234,557.81
AAA 以下	—
未评级	—
合计	62,234,557.81

注：本基金本报告期末无未评级的长期信用债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

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

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动

投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于本报告期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于本报告期末，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有的利率敏感性资产存在相应的利率风险。本期持有银行存款、债券投资和国债期货等利率敏感性资产。

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	1,762,599.48	-	-	-	1,762,599.48
结算备付金	7,026,068.22	-	-	-	7,026,068.22
存出保证金	-	-	-	398,125.00	398,125.00
交易性金融资产	10,314,980.82	19,482,020.00	95,012,349.17	57,146,672.82	181,956,022.81
买入返售金融资产	3,000,030.00	-	-	-	3,000,030.00

应收申购款	-	-	-	8,987.36	8,987.36
其他资产	-	-	-	62,277.14	62,277.14
资产总计	22,103,678.52	19,482,020.00	95,012,349.17	57,616,062.32	194,214,110.01
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	1,600,589.34	1,600,589.34
应付管理人报酬	-	-	-	115,674.76	115,674.76
应付托管费	-	-	-	28,918.67	28,918.67
应付销售服务费	-	-	-	30,239.26	30,239.26
应交税费	-	-	-	6,354.17	6,354.17
其他负债	-	-	-	24,559.86	24,559.86
负债总计	-	-	-	1,806,336.06	1,806,336.06
利率敏感度缺口	22,103,678.52	19,482,020.00	95,012,349.17	55,809,726.26	192,407,773.95

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的到期日予以分类。

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	
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）
	利率上升 25bp	-2,027,979.70
	利率下降 25bp	2,103,886.78

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。

本基金的基金管理人在注重严格风险控制的基础上，动态调整资产配置，使风险和预期目标相匹配，并选择符合基金合同约定范围内的投资品种进行投资。同时，本基金充分发挥基金管理人的研究优势，通过对经济发展、社会结构、宏观政策、产业政策和科学技术的跟踪研究，将定性分析和定量模型相结合，根据投资策略或市场环境的变化构建和管理投资组合，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金对股票（含存托凭证）、权益类基金、可转换债券（含可分离交易可转债）及可交换债

券的投资比例合计为基金资产的 10%-30%，其中投资于境内股票资产（含 A 股股票型 ETF）的比例合计不低于基金资产的 10%，投资于港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-50%；本基金持有其他基金，其市值不超过基金资产净值的 10%；每个交易日日终在扣除国债期货合约、股指期货合约和股票期权合约所需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，以识别和测算本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 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	57,146,672.82	29.70
交易性金融资产－基金投资	—	—
交易性金融资产－债券投资	—	—
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	57,146,672.82	29.70

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%	19,183,091.80
	业绩比较基准下降 5%	-19,183,091.80

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	57,146,672.82
第二层次	124,809,349.99
第三层次	—
合计	181,956,022.81

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债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；对于定期开放的基金投资，本基金不会于封闭期将相关基金列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括货币资金、应收款项和其他金融负债，其公允价值和账面价值相等。

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	57,146,672.82	29.42
	其中：股票	57,146,672.82	29.42
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	124,809,349.99	64.26
	其中：债券	124,809,349.99	64.26
	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	3,000,030.00	1.54
	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	8,788,667.70	4.53
8	其他各项资产	469,389.50	0.24
9	合计	194,214,110.01	100.00

注：1、本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

2、本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

3、本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

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	1,277,912.00	0.66
B	采矿业	1,458,532.00	0.76
C	制造业	41,095,068.92	21.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	32,712.00	0.02
E	建筑业	2,513,135.00	1.31
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,919,772.90	1.52
J	金融业	4,976,952.00	2.59

K	房地产业	2,695,512.00	1.40
L	租赁和商务服务业	145,746.00	0.08
M	科学研究和技术服务业	31,330.00	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	57,146,672.82	29.70

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	3,000	3,810,000.00	1.98
2	300502	新易盛	4,260	2,585,820.00	1.34
3	600176	中国巨石	29,800	2,171,824.00	1.13
4	300896	爱美客	13,200	1,151,040.00	0.60
5	601318	中国平安	23,300	1,112,342.00	0.58
6	600585	海螺水泥	61,700	1,045,815.00	0.54
7	002080	中材科技	11,200	1,008,000.00	0.52
8	603605	珀莱雅	16,300	976,696.00	0.51
9	688256	寒武纪	598	954,138.90	0.50
10	300750	宁德时代	2,200	864,622.00	0.45
11	600048	保利发展	155,600	720,428.00	0.37
12	002475	立讯精密	10,000	704,000.00	0.37
13	688041	海光信息	1,900	703,570.00	0.37
14	300394	天孚通信	2,260	684,056.80	0.36
15	002594	比亚迪	8,400	669,480.00	0.35
16	300957	贝泰妮	20,200	636,502.00	0.33
17	002714	牧原股份	16,900	591,331.00	0.31
18	600487	亨通光电	5,400	590,436.00	0.31
19	000063	中兴通讯	15,400	557,326.00	0.29
20	000786	北新建材	30,700	555,363.00	0.29
21	002384	东山精密	2,100	550,935.00	0.29
22	688363	华熙生物	15,400	550,858.00	0.29
23	601668	中国建筑	124,100	538,594.00	0.28
24	002371	北方华创	600	530,736.00	0.28
25	002271	东方雨虹	44,700	530,589.00	0.28

26	688981	中芯国际	3,300	524,106.00	0.27
27	600030	中信证券	17,500	502,775.00	0.26
28	300059	东方财富	24,400	497,272.00	0.26
29	688008	澜起科技	1,600	495,840.00	0.26
30	603986	兆易创新	600	489,000.00	0.25
31	600315	上海家化	28,900	486,098.00	0.25
32	601138	工业富联	6,600	476,190.00	0.25
33	001979	招商蛇口	72,800	468,104.00	0.24
34	688012	中微公司	988	462,878.00	0.24
35	300498	温氏股份	37,500	462,000.00	0.24
36	300476	胜宏科技	1,300	450,359.00	0.23
37	600522	中天科技	7,400	449,032.00	0.23
38	300888	稳健医疗	15,300	428,247.00	0.22
39	601728	中国电信	80,600	418,314.00	0.22
40	600941	中国移动	4,800	413,424.00	0.21
41	002511	中顺洁柔	61,300	407,645.00	0.21
42	000725	京东方 A	45,300	393,204.00	0.20
43	601899	紫金矿业	15,600	392,184.00	0.20
44	601211	国泰海通	21,300	387,660.00	0.20
45	000338	潍柴动力	14,100	384,225.00	0.20
46	300124	汇川技术	5,600	371,448.00	0.19
47	002463	沪电股份	2,300	351,440.00	0.18
48	600515	海南机场	122,900	336,746.00	0.18
49	300442	润泽科技	3,900	323,973.00	0.17
50	600031	三一重工	18,700	323,136.00	0.17
51	002281	光迅科技	1,200	308,328.00	0.16
52	600208	衢州发展	107,800	305,074.00	0.16
53	688525	佰维存储	600	296,838.00	0.15
54	601669	中国电建	63,100	296,570.00	0.15
55	600050	中国联通	72,900	291,600.00	0.15
56	601390	中国中铁	69,400	289,398.00	0.15
57	601857	中国石油	33,200	288,176.00	0.15
58	600801	华新建材	17,400	271,440.00	0.14
59	002008	大族激光	1,700	255,187.00	0.13
60	600660	福耀玻璃	5,000	252,200.00	0.13
61	300408	三环集团	1,500	250,350.00	0.13
62	603737	三棵树	10,240	246,784.00	0.13
63	601868	中国能建	86,200	230,154.00	0.12
64	000425	徐工机械	27,600	223,284.00	0.12
65	000100	TCL 科技	38,200	222,324.00	0.12
66	601601	中国太保	7,600	216,752.00	0.11
67	002353	杰瑞股份	1,400	213,500.00	0.11
68	301308	江波龙	300	211,140.00	0.11

69	600183	生益科技	1,200	208,080.00	0.11
70	300604	长川科技	600	204,852.00	0.11
71	002311	海大集团	4,500	200,745.00	0.10
72	601688	华泰证券	9,700	200,014.00	0.10
73	688120	华海清科	620	199,751.60	0.10
74	601186	中国铁建	33,000	196,350.00	0.10
75	002244	滨江集团	25,400	193,040.00	0.10
76	300136	信维通信	1,600	190,800.00	0.10
77	600938	中国海油	7,000	190,050.00	0.10
78	601127	赛力斯	3,100	189,875.00	0.10
79	601155	新城控股	18,200	186,732.00	0.10
80	600498	烽火通信	2,500	184,000.00	0.10
81	002916	深南电路	400	183,160.00	0.10
82	601117	中国化学	24,900	183,015.00	0.10
83	603501	豪威集团	1,900	180,215.00	0.09
84	600584	长电科技	1,700	176,035.00	0.09
85	000002	万科 A	57,200	169,312.00	0.09
86	600028	中国石化	37,000	165,020.00	0.09
87	601766	中国中车	31,400	163,280.00	0.08
88	002372	伟星新材	18,500	151,515.00	0.08
89	002156	通富微电	1,900	144,153.00	0.07
90	300274	阳光电源	900	143,118.00	0.07
91	600066	宇通客车	5,200	139,412.00	0.07
92	002241	歌尔股份	6,000	135,180.00	0.07
93	000625	长安汽车	18,400	131,928.00	0.07
94	600104	上汽集团	13,500	131,760.00	0.07
95	601100	恒立液压	1,200	129,072.00	0.07
96	688361	中科飞测	300	129,000.00	0.07
97	600848	上海临港	16,800	125,832.00	0.07
98	300223	北京君正	500	124,450.00	0.06
99	000776	广发证券	5,300	124,020.00	0.06
100	300383	光环新网	9,800	121,912.00	0.06
101	002157	正邦科技	43,300	121,673.00	0.06
102	603296	华勤技术	1,620	120,317.40	0.06
103	688387	信科移动-U	6,000	119,040.00	0.06
104	601689	拓普集团	2,100	118,482.00	0.06
105	688777	中控技术	1,000	117,500.00	0.06
106	601618	中国中冶	47,400	115,656.00	0.06
107	002049	紫光国微	1,300	115,375.00	0.06
108	002131	利欧股份	24,000	114,000.00	0.06
109	601628	中国人寿	3,200	113,120.00	0.06
110	300433	蓝思科技	2,100	112,686.00	0.06
111	600663	陆家嘴	17,600	110,528.00	0.06

112	002600	领益智造	6,300	109,242.00	0.06
113	603993	洛阳钼业	6,200	108,810.00	0.06
114	601800	中国交建	18,900	107,919.00	0.06
115	000157	中联重科	15,200	105,944.00	0.06
116	002938	鹏鼎控股	1,000	105,380.00	0.05
117	002126	银轮股份	2,100	104,580.00	0.05
118	600999	招商证券	4,900	103,390.00	0.05
119	002595	豪迈科技	2,200	102,520.00	0.05
120	002436	兴森科技	2,000	101,900.00	0.05
121	688126	沪硅产业	2,500	99,725.00	0.05
122	000876	新希望	15,600	97,812.00	0.05
123	000021	深科技	1,500	96,405.00	0.05
124	002273	水晶光电	2,700	95,796.00	0.05
125	300054	鼎龙股份	900	95,373.00	0.05
126	300567	精测电子	300	95,280.00	0.05
127	601611	中国核建	8,500	94,775.00	0.05
128	300628	亿联网络	2,800	94,696.00	0.05
129	603893	瑞芯微	500	94,180.00	0.05
130	600346	恒力石化	5,300	93,863.00	0.05
131	601058	赛轮轮胎	8,100	93,393.00	0.05
132	600737	中粮糖业	7,500	92,475.00	0.05
133	600958	东方证券	9,700	91,568.00	0.05
134	000166	申万宏源	20,500	90,200.00	0.05
135	003031	中瓷电子	500	90,150.00	0.05
136	600606	绿地控股	74,000	89,540.00	0.05
137	601336	新华保险	1,500	89,490.00	0.05
138	300782	卓胜微	800	87,664.00	0.05
139	600460	士兰微	1,600	87,456.00	0.05
140	600111	北方稀土	1,800	86,490.00	0.04
141	300661	圣邦股份	600	86,088.00	0.04
142	000032	深桑达 A	3,400	84,830.00	0.04
143	002185	华天科技	3,800	84,778.00	0.04
144	688017	绿的谐波	200	83,572.00	0.04
145	688099	晶晨股份	800	82,320.00	0.04
146	600170	上海建工	36,900	81,918.00	0.04
147	689009	九号公司	2,100	80,115.00	0.04
148	600007	中国国贸	4,200	79,716.00	0.04
149	300999	金龙鱼	3,400	79,084.00	0.04
150	688469	芯联集成-U	7,400	78,514.00	0.04
151	002460	赣锋锂业	1,200	78,480.00	0.04
152	603799	华友钴业	1,600	77,216.00	0.04
153	603129	春风动力	300	76,740.00	0.04
154	601012	隆基绿能	5,800	76,096.00	0.04

155	688213	思特威	700	74,949.00	0.04
156	601600	中国铝业	9,100	74,802.00	0.04
157	688220	翱捷科技	600	74,592.00	0.04
158	600089	特变电工	3,300	74,250.00	0.04
159	601377	兴业证券	12,200	73,688.00	0.04
160	600741	华域汽车	4,700	72,944.00	0.04
161	600820	隧道股份	13,900	72,419.00	0.04
162	601995	中金公司	2,000	72,300.00	0.04
163	300285	国瓷材料	700	72,226.00	0.04
164	300014	亿纬锂能	1,100	71,533.00	0.04
165	688385	复旦微电	1,000	71,290.00	0.04
166	002472	双环传动	1,700	70,567.00	0.04
167	002028	思源电气	400	69,200.00	0.04
168	002444	巨星科技	2,200	68,420.00	0.04
169	688396	华润微	700	68,285.00	0.04
170	002409	雅克科技	300	67,350.00	0.04
171	600699	均胜电子	3,100	66,991.00	0.03
172	688172	燕东微	800	66,928.00	0.03
173	600970	中材国际	9,300	66,309.00	0.03
174	002138	顺络电子	900	65,790.00	0.03
175	600039	四川路桥	8,400	65,688.00	0.03
176	002493	荣盛石化	6,100	65,575.00	0.03
177	603228	景旺电子	900	65,169.00	0.03
178	688036	传音控股	1,100	64,845.00	0.03
179	600406	国电南瑞	2,800	63,980.00	0.03
180	002385	大北农	23,000	63,480.00	0.03
181	300373	扬杰科技	400	62,892.00	0.03
182	601233	桐昆股份	2,900	62,785.00	0.03
183	300866	安克创新	600	62,700.00	0.03
184	600499	科达制造	4,500	62,100.00	0.03
185	688047	龙芯中科	400	61,868.00	0.03
186	002466	天齐锂业	1,000	61,320.00	0.03
187	601555	东吴证券	7,700	60,984.00	0.03
188	000703	恒逸石化	4,400	59,708.00	0.03
189	603766	隆鑫通用	5,000	59,650.00	0.03
190	000301	东方盛虹	5,200	59,540.00	0.03
191	601901	方正证券	8,200	59,040.00	0.03
192	601633	长城汽车	3,900	58,851.00	0.03
193	603179	新泉股份	1,180	58,587.00	0.03
194	601231	环旭电子	1,800	58,320.00	0.03
195	000559	万向钱潮	4,500	58,185.00	0.03
196	300024	机器人	3,000	57,990.00	0.03
197	688052	纳芯微	200	57,662.00	0.03

198	000039	中集集团	7,000	56,770.00	0.03
199	601108	财通证券	6,500	56,225.00	0.03
200	002299	圣农发展	3,700	56,092.00	0.03
201	000408	藏格矿业	800	55,456.00	0.03
202	000807	云铝股份	2,500	55,350.00	0.03
203	605358	立昂微	700	54,320.00	0.03
204	600598	北大荒	5,000	54,200.00	0.03
205	601788	光大证券	3,700	53,391.00	0.03
206	601881	中国银河	4,200	52,794.00	0.03
207	600489	中金黄金	2,900	52,345.00	0.03
208	601456	国联民生	5,900	52,156.00	0.03
209	688234	天岳先进	300	52,053.00	0.03
210	002736	国信证券	5,200	51,948.00	0.03
211	601717	中创智领	3,700	51,467.00	0.03
212	002797	第一创业	7,800	51,246.00	0.03
213	600549	厦门钨业	600	51,120.00	0.03
214	000783	长江证券	5,100	49,725.00	0.03
215	601198	东兴证券	3,600	48,924.00	0.03
216	601118	海南橡胶	9,900	48,708.00	0.03
217	688187	时代电气	700	48,062.00	0.02
218	002085	万丰奥威	4,300	47,687.00	0.02
219	601878	浙商证券	5,000	47,500.00	0.02
220	600988	赤峰黄金	1,800	47,376.00	0.02
221	002738	中矿资源	800	47,192.00	0.02
222	601066	中信建投	1,600	46,512.00	0.02
223	603596	伯特利	1,868	46,401.12	0.02
224	002709	天赐材料	900	46,287.00	0.02
225	600547	山东黄金	2,000	46,180.00	0.02
226	601162	天风证券	13,700	46,169.00	0.02
227	002202	金风科技	1,900	45,410.00	0.02
228	601099	太平洋	13,200	44,484.00	0.02
229	600166	福田汽车	15,100	43,941.00	0.02
230	000630	铜陵有色	6,900	43,884.00	0.02
231	000617	中油资本	6,600	43,494.00	0.02
232	601319	中国人保	6,400	43,264.00	0.02
233	603160	汇顶科技	700	43,197.00	0.02
234	000426	兴业银锡	1,300	42,848.00	0.02
235	605117	德业股份	400	42,472.00	0.02
236	600109	国金证券	4,800	42,144.00	0.02
237	002532	天山铝业	3,900	41,847.00	0.02
238	300450	先导智能	1,000	40,720.00	0.02
239	000728	国元证券	5,300	39,697.00	0.02
240	603298	杭叉集团	1,600	38,176.00	0.02

241	000933	神火股份	1,800	38,160.00	0.02
241	600563	法拉电子	200	38,160.00	0.02
243	601168	西部矿业	1,400	37,996.00	0.02
244	688728	格科微	1,800	37,872.00	0.02
245	000887	中鼎股份	2,100	37,569.00	0.02
246	300390	天华新能	400	37,404.00	0.02
247	601799	星宇股份	400	36,248.00	0.02
248	600909	华安证券	3,200	35,552.00	0.02
249	601696	中银证券	2,800	35,420.00	0.02
250	000951	中国重汽	1,800	35,118.00	0.02
251	600061	国投资本	5,300	34,715.00	0.02
252	600875	东方电气	1,200	34,524.00	0.02
253	600918	中泰证券	6,400	34,048.00	0.02
254	601238	广汽集团	6,700	34,036.00	0.02
255	000975	山金国际	2,000	34,000.00	0.02
256	002673	西部证券	5,200	33,748.00	0.02
257	000750	国海证券	9,100	33,488.00	0.02
258	600482	中国动力	1,000	32,800.00	0.02
259	000958	电投产融	5,800	32,712.00	0.02
260	601106	中国一重	9,900	32,670.00	0.02
261	601399	国机重装	9,300	32,550.00	0.02
262	000415	渤海租赁	7,800	31,746.00	0.02
263	600720	中交设计	6,500	31,330.00	0.02
264	002841	视源股份	900	31,077.00	0.02
265	600901	江苏金租	5,400	31,050.00	0.02
266	688009	中国通号	6,500	30,940.00	0.02
267	603290	斯达半导	200	30,588.00	0.02
268	600707	彩虹股份	1,800	30,402.00	0.02
269	600362	江西铜业	700	30,310.00	0.02
270	000960	锡业股份	700	29,883.00	0.02
271	603338	浙江鼎力	700	29,750.00	0.02
272	600583	海油工程	5,900	29,677.00	0.02
273	600369	西南证券	7,200	28,944.00	0.02
274	601990	南京证券	4,400	28,908.00	0.02
275	601608	中信重工	5,900	28,143.00	0.01
276	600219	南山铝业	7,000	27,930.00	0.01
277	000050	深天马 A	2,800	27,748.00	0.01
278	000831	中国稀土	500	27,745.00	0.01
279	600392	盛和资源	900	26,793.00	0.01
280	002984	森麒麟	2,000	26,140.00	0.01
281	600582	天地科技	5,800	25,810.00	0.01
282	688538	和辉光电-U	9,900	25,740.00	0.01
283	601966	玲珑轮胎	2,500	25,475.00	0.01

284	002926	华西证券	3,000	24,510.00	0.01
285	301498	乖宝宠物	600	24,354.00	0.01
286	601059	信达证券	1,500	24,285.00	0.01
287	002155	湖南黄金	1,000	23,870.00	0.01
288	600390	五矿资本	5,000	22,800.00	0.01
289	000987	越秀资本	2,900	22,678.00	0.01
290	002939	长城证券	2,700	22,518.00	0.01
291	300100	双林股份	800	22,224.00	0.01
292	600528	中铁工业	3,200	21,088.00	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	4,183,344.00	2.17
2	600900	长江电力	4,056,381.00	2.11
3	600673	东阳光	3,656,857.00	1.90
4	600519	贵州茅台	3,465,957.84	1.80
5	300502	新易盛	2,734,722.00	1.42
6	002714	牧原股份	2,684,783.00	1.40
7	300896	爱美客	2,562,796.00	1.33
8	600585	海螺水泥	2,545,935.00	1.32
9	300498	温氏股份	2,447,865.00	1.27
10	601318	中国平安	2,290,477.00	1.19
11	300750	宁德时代	2,252,020.00	1.17
12	600176	中国巨石	2,248,085.00	1.17
13	600048	保利发展	2,218,100.00	1.15
14	603605	珀莱雅	2,022,529.00	1.05
15	601728	中国电信	2,020,273.00	1.05
16	000063	中兴通讯	1,853,744.00	0.96
17	600941	中国移动	1,798,783.00	0.93
18	600036	招商银行	1,625,549.00	0.84
19	601857	中国石油	1,574,894.00	0.82
20	600028	中国石化	1,456,291.00	0.76

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	600900	长江电力	3,985,428.00	2.07
2	600673	东阳光	3,401,870.08	1.77
3	600519	贵州茅台	3,269,165.00	1.70

4	300308	中际旭创	2,833,660.00	1.47
5	300498	温氏股份	1,906,426.00	0.99
6	002714	牧原股份	1,871,858.00	0.97
7	300502	新易盛	1,800,192.00	0.94
8	601728	中国电信	1,605,947.00	0.83
9	600036	招商银行	1,585,972.00	0.82
10	600941	中国移动	1,371,925.00	0.71
11	600048	保利发展	1,347,888.00	0.70
12	300750	宁德时代	1,321,044.00	0.69
13	601857	中国石油	1,316,291.00	0.68
14	000063	中兴通讯	1,285,310.00	0.67
15	600585	海螺水泥	1,244,488.00	0.65
16	000333	美的集团	1,214,607.00	0.63
17	600028	中国石化	1,171,155.00	0.61
18	601166	兴业银行	1,137,122.00	0.59
19	600176	中国巨石	1,040,845.00	0.54
20	600276	恒瑞医药	1,011,766.00	0.53

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	180,359,702.48
卖出股票收入（成交）总额	124,309,560.85

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	41,962,468.89	21.81
2	央行票据	—	—
3	金融债券	82,846,881.10	43.06
	其中：政策性金融债	20,612,323.29	10.71
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	124,809,349.99	64.87

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	232380089	23 中信银行 二级资本债 01A	100,000	10,547,640.55	5.48
2	232480004	24 农行二级 资本债 01A	100,000	10,398,715.07	5.40
3	092280134	22 工行二级 资本债 04A	100,000	10,388,205.48	5.40
4	232480008	24 中行二级 资本债 02A	100,000	10,325,236.71	5.37
5	2128028	21 邮储银行 二级 01	100,000	10,322,239.45	5.36

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金以套期保值与风险敞口管理为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适度参与股指期货投资。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，运用股指期货管理现金流、减少系统性风险以及降低特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等。

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

本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场定性和定量的分析，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金在利率快速偏离长期公允价值的情况时进行了国债期货套保交易，适当适时调整本基金的久期风险，并且在利率回归公允价值时结束套保交易。本报告期，本基金投资国债期货符合既定的投资政策和投资目的。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、中国进出口银行、中国工商银行股份有限公司、国家开发银行、中国邮政储蓄银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、中信银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到处罚。上述证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

7.12.2

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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	398,125.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	8,987.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	62,277.14
8	其他	-
9	合计	469,389.50

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例

贝莱德富元金利混合 A	280	445,465.83	40,599,734.37	32.55 %	84,130,699.27	67.45 %
贝莱德富元金利混合 C	2,311	27,733.36	0.00	0.00 %	64,091,784.86	100.00 %
合计	2,591	72,876.19	40,599,734.37	21.50 %	148,222,484.13	78.50 %

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
基金管理人所有从业人员持有本基金	贝莱德富元金利混合 A	199,193.98	0.1597 %
	贝莱德富元金利混合 C	110,007.22	0.1716 %
	合计	309,201.20	0.1638 %

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	贝莱德富元金利混合 A	0
	贝莱德富元金利混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	贝莱德富元金利混合 A	10~50
	贝莱德富元金利混合 C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	贝莱德富元金利混合 A	贝莱德富元金利混合 C
基金合同生效日 （2026 年 02 月 10 日）基金份额总额	254,048,977.68	217,295,358.61
基金合同生效日起	1,203,665.55	1,072,288.86

至报告期期末基金总申购份额		
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	130,522,209.59	154,275,862.61
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	124,730,433.64	64,091,784.86

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

基金管理人：2026 年上半年，基金管理人未发生重大人事变动。

基金托管人：本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及影响基金管理人经营或基金运营业务，或与基金财产相关的诉讼。

本报告期无涉及基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内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

本报告期内托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信证券股份有限公司	2	304,669,272.40	100.00	196,262.23	100.00	-

- 注：1、此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、债券、债券回购、权证等交易（如有）而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。
- 2、本基金采用券商交易模式。根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，基金管理人管理的采用券商交易模式的基金，不适用有关交易佣金集中度限制的规定。
- 3、本基金管理人选择财务状况良好、经营行为规范、研究实力较强、能满足公募基金采用券商交易模式进行证券交易和结算需要的证券公司作为本基金的证券经纪商。
- 4、本基金管理人与选择的证券经纪商、本基金的托管人签订证券经纪服务协议，对账户管理、资金存管、交易执行、交易管理、佣金收取、清算交收、违约责任等作出约定。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
中信	316,719,051.00	100.00	5,232,470,000.00	100.00	-	-	-	-

证 券 股 份 有 限 公 司								
--------------------------------------	--	--	--	--	--	--	--	--

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	贝莱德富元金利混合型证券投资基金基金份额发售公告	中国证监会规定媒介	2026 年 1 月 15 日
2	贝莱德富元金利混合型证券投资基金托管协议	中国证监会规定媒介	2026 年 1 月 15 日
3	贝莱德富元金利混合型证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒介	2026 年 1 月 15 日
4	贝莱德富元金利混合型证券投资基金招募说明书	中国证监会规定媒介	2026 年 1 月 15 日
5	贝莱德富元金利混合型证券投资基金(A 类份额)基金产品资料概要	中国证监会规定媒介	2026 年 1 月 15 日
6	贝莱德富元金利混合型证券投资基金(C 类份额)基金产品资料概要	中国证监会规定媒介	2026 年 1 月 15 日
7	关于贝莱德富元金利混合型证券投资基金增加销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2026 年 1 月 23 日
8	贝莱德富元金利混合型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会规定媒介	2026 年 2 月 11 日
9	贝莱德富元金利混合型证券投资基金(A 类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2026 年 2 月 12 日
10	贝莱德富元金利混合型证券投资基金(C 类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2026 年 2 月 12 日
11	贝莱德富元金利混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务公告	中国证监会规定媒介	2026 年 3 月 23 日
12	贝莱德基金管理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 年 3 月 31 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

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

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、本基金的中国证监会批准募集文件
- 2、本基金的基金合同
- 3、本基金的招募说明书
- 4、本基金的托管协议
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本基金的公告
- 7、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人的办公场所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 7 楼 702 室。

12.3 查阅方式

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

贝莱德基金管理有限公司

2026 年 8 月 31 日