

华宝新价值灵活配置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：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

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，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 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 01 月 01 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	5
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	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	50
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	51
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	51

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	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.12 投资组合报告附注	51
§ 8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 盈利投资者数量占比	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	53
§ 9 开放式基金份额变动	53
§ 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	54
10.8 其他重大事件	58
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	58
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	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	59
§ 12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华宝新价值混合
基金主代码	001324
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 6 月 1 日
基金管理人	华宝基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	110,890,886.03 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，本基金通过大类资产间的灵活配置和多样的投资策略，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采取积极的股票选择策略，将“自上而下”的行业配置策略和“自下而上”的股票精选策略相结合，根据对宏观经济和市场风险特征变化的判断，进行投资组合的动态优化，实现基金资产长期稳定增值。
业绩比较基准	1 年期银行定期存款基准利率（税后）+3%
风险收益特征	本基金是一只主动投资的混合型基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

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		华宝基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周雷	许俊
	联系电话	021-38505888	010-66596688
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400-700-5588、400-820-5050	95566
传真		021-38505777	010-66594942
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		夏雪松	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
----------------	-------

登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金中期报告置备地点	基金管理人办公场所和基金托管人住所。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	基金管理人	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 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 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	16,562,138.26
本期利润	25,186,083.25
加权平均基金份额本期利润	0.2090
本期加权平均净值利润率	10.03%
本期基金份额净值增长率	10.31%
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	99,076,296.12
期末可供分配基金份额利润	0.8935
期末基金资产净值	247,125,811.14
期末基金份额净值	2.2285
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	122.85%

- 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，本期利润等于本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
3. 净值相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。
4. 期末可供分配利润采用资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

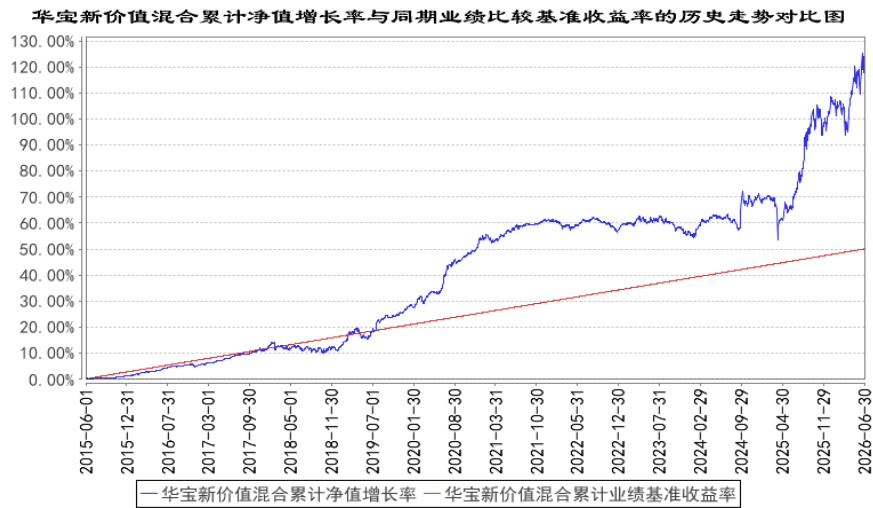
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去三个月	13.91%	1.18%	1.12%	0.01%	12.79%	1.17%
过去六个月	10.31%	1.07%	2.23%	0.02%	8.08%	1.05%
过去一年	31.42%	0.96%	4.50%	0.01%	26.92%	0.95%
过去三年	38.11%	0.69%	13.50%	0.01%	24.61%	0.68%
过去五年	40.85%	0.54%	22.50%	0.01%	18.35%	0.53%
过去七年	88.06%	0.48%	31.50%	0.01%	56.56%	0.47%
过去十年	114.80%	0.42%	45.00%	0.01%	69.80%	0.41%
自基金合同生效起至今	122.85%	0.40%	50.06%	0.01%	72.79%	0.39%

注：（1）基金业绩基准：1 年期银行定期存款基准利率（税后）+3%；

（2）净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

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：按照基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定，截至 2015 年 12 月 01 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

§ 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

华宝基金管理有限公司（公司原名“华宝兴业基金管理有限公司”）于 2003 年 2 月 12 日经中国证监会批准设立，2003 年 3 月 7 日在国家工商总局注册登记并正式开业，是国内首批中外合资基金管理公司。成立之初，公司注册资本为 1 亿元人民币，2007 年经中国证监会批准，公司注册

资本增加至 1.5 亿元人民币。2017 年公司名称变更为“华宝基金管理有限公司”。目前公司股东为华宝信托有限责任公司、美国华平资产管理有限合伙（Warburg Pincus Asset Management, L.P.）和江苏省铁路集团有限公司，持有股权占比分别为 51%、29%、20%。公司在北京和深圳设有分公司。截至本报告期末（2026 年 06 月 30 日），本公司正在管理运作的公开募集证券投资基金共 178 只，涵盖股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金、FOF 等。

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		
林昊	本基金基金经理	2017-03-17	-	20 年	硕士。2006 年 5 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任渠道经理、交易员、高级交易员、基金经理助理等职务。2017 年 3 月起任华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 3 月至 2023 年 3 月任华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 12 月至 2018 年 7 月任华宝新回报一年定期开放混合型证券投资基金基金经理，2017 年 12 月至 2018 年 6 月任华宝新动力一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 12 月至 2018 年 12 月任华宝新优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018 年 8 月至 2021 年 3 月任华宝宝丰高等级债券型发起式证券投资基金基金经理，2019 年 11 月起任华宝宝惠纯债 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，2020 年 7 月起任华宝宝利纯债 86 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，2020 年 9 月起任华宝中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金基金经理，2021 年 6 月至 2023 年 3 月任华宝安盈混合型证券投资基金基金经理，2021 年 8 月起任华宝安享混合型证券投资基金基金经理，2021 年 9 月至 2022 年 6 月任华宝安益混合型证券投资基金基金经理，2025 年 9 月起任华宝安睿债券型证券投资基金基金经理，2026 年 4 月起任华宝安润六个月持有期债券型证券投资基金基金经理。
唐雪倩	本基金基金经	2024-06-14	-	11 年	硕士。2015 年 7 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任分析师、基金经理助理等

	理				职务。2021 年 10 月起任华宝安享混合型证券投资基金基金经理，2021 年 10 月至 2022 年 6 月任华宝安益混合型证券投资基金基金经理，2022 年 6 月起任华宝红利精选混合型证券投资基金基金经理，2022 年 8 月至 2023 年 11 月任华宝高端装备股票型发起式证券投资基金基金经理，2023 年 4 月起任华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理，2023 年 4 月至 2024 年 1 月任华宝未来主导产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2023 年 9 月起任华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2024 年 6 月起任华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2025 年 3 月至 2025 年 10 月任华宝远识混合型证券投资基金基金经理，2025 年 9 月起任华宝安睿债券型证券投资基金基金经理，2026 年 4 月起任华宝安润六个月持有期债券型证券投资基金基金经理。
--	---	--	--	--	--

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

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

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

本报告期内，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制，确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求，分析了本公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股

票、债券)的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差;分析结果未发现异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 2 次,系指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内,本基金没有发现异常交易行为。

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,市场在一季度下旬受地缘冲突的影响一度略有扰动,但总体呈现极强的 K 型特征,整体权益市场波动中上行,呈现极端的一九行情,科技及成长赛道快速估值拔升,其余板块不同程度回落。总体而言,上证 50、沪深 300、中证 500、中证 1000 分别上涨-1.38%、7.55%、20.97%、15.99%,中信五个风格板块中成长风格指数半年度上涨 36.71%,金融、周期、消费、稳定风格指数分别下跌 12.58%、4.31%、13.46%、6.36%。科技是上半年 A 股逻辑和业绩叙事的核心,但与此同时,这也推动市场的分化程度到达历史极值,截止二季度末,31 个申万一级行业首尾季度收益差超过 110%,处于 2015 年初以来过去十一年半的历史最高点;成长特别是 AI 链条对于其它市场板块的虹吸效应明显,前 20%的股票占据了全市场 75%的流动性,其中前 18 只股票的季度成交额占两市 5200 只股票总成交额的比例超过 10%。从宽基指数的层面,由于沪深 300 基准指数并非聚焦单一风格和主题的指数,指数层面的估值在各方向均衡后整体扩张稳健,截止二季度末,沪深 300 指数的 PE 为 14.34 倍, PB 为 1.45 倍,整体估值相对可控;但指数层面可控的同时不可掩盖其内部的高度结构分化,随着估值的拔升,科技股票对于边际信息的反应相对敏感,进入半年报季,业绩的验证性仍将成为估值的重要支撑,投资端将更加重视业绩边际态势在选股中的重要作用。

新价值基金自去年二季度完成转型,目前为高仓位权益型产品,整体策略延续不变。未来在长期中仍将恪守投资边际,在 A 股市场中寻找具有较高盈利质量、行业代表性、且估值具备长期合理性的股票进行组合配置,以期在长期中为持有人寻找和实现可以满足资产配置收益需求的长期收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为 10.31%,业绩比较基准收益率为 2.23%。

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 2026 年下半年，全球经济延续分化，地缘冲突影响通胀中枢，联储加息路径将是未来外部风险偏好博弈的关键。国内经济新旧动能转换势头不变，政策上大概率保持宽松，出口持续超预期是上半年经济保持增长的最大亮点，一方面中国产业结构不断升级推动中国在全球贸易中的份额不断上行，另一方面 AI 基础设施增速较高也带动了出口需求，出口增速高增长对完成年度经济增长目标构成支撑。消费端，以旧换新政策效应持续释放，服务消费保持韧性，但居民收入预期修复偏慢仍将制约消费回升斜率。投资端制造业投资受益于产业升级维持较高景气，基建与房地产投资难以 V 型反转但有望边际改善。货币政策预计延续精准有力基调，财政政策将更加注重提质增效，特别国债与专项债的落地节奏是关键变量。整体而言，名义 GDP 增速的回升和央行货币政策都对权益类资产构成支撑，行业层面需要根据行业发展趋势、景气度的边际变化、估值、投资者行为模式等动态思考权益类资产的仓位和行业配置。我们对权益市场特别是核心绩优、或业绩保持长期的稳健的资产下半年的表现保持乐观，与此同时，上半年极致分化后波动料将加剧，风格或从单一抱团转向适度均衡。叠加中报季业绩验证期到来，对盈利的观察仍然是下半年投资判断的关键。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人设有估值委员会，定期评价现行估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法。基金在投资新品种时，由估值委员会评价现有估值政策和程序的适用性。参与估值的人员均具备估值业务所需的专业胜任能力，参与估值各方之间不存在重大利益冲突。

本基金的估值由基金会计负责，基金会计以本基金为会计核算主体，基金会计核算独立于公司会计核算，独立建账、独立核算。基金会计采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及账务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理人与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式进行；基金会计每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对，每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人低于二百人或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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金（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。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在本托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、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：华宝新价值灵活配置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	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	1,403,141.68	201,216.02
结算备付金		5,192,271.26	4,310,269.73

存出保证金		2,808,967.42	2,688,645.82
交易性金融资产	6.4.7.2	224,317,536.82	235,299,347.55
其中：股票投资		210,810,673.17	221,895,448.40
基金投资		-	-
债券投资		13,506,863.65	13,403,899.15
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	13,769,000.00	15,514,667.39
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		161,049.05	142,905.74
应收股利		-	-
应收申购款		58,949.12	104,633.63
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		247,710,915.35	258,261,685.88
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	143,542.46
应付赎回款		267,511.90	88,084.04
应付管理人报酬		122,298.36	129,987.52
应付托管费		40,766.12	43,329.17
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		37,112.49	47,739.03
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	117,415.34	219,870.26
负债合计		585,104.21	672,552.48
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	110,890,886.03	127,508,978.49
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	136,234,925.11	130,080,154.91

净资产合计		247,125,811.14	257,589,133.40
负债和净资产总计		247,710,915.35	258,261,685.88

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.2285 元，基金份额总额 110,890,886.03 份。

6.2 利润表

会计主体：华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		26,285,932.35	2,531,752.65
1. 利息收入		110,120.43	87,207.41
其中：存款利息收入	6.4.7.9	14,983.35	15,302.82
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		95,137.08	71,904.59
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		17,520,265.24	4,174,533.55
其中：股票投资收益	6.4.7.10	12,256,247.93	200,764.69
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	73,499.95	587,880.25
资产支持证券投 资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	3,007,061.06	602,057.52
股利收益	6.4.7.15	2,183,456.30	2,783,831.09
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）	6.4.7.16	8,623,944.99	-1,949,380.03
4. 汇兑收益（损失以 “-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以 “-”号填列）	6.4.7.17	31,601.69	219,391.72
减：二、营业总支出		1,099,849.10	787,259.02

1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	746, 522. 55	527, 571. 74
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	248, 840. 77	175, 857. 24
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	234. 46
其中：卖出回购金融资产支出		-	234. 46
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 18	-	-
7. 税金及附加		10, 920. 57	2, 181. 46
8. 其他费用	6. 4. 7. 19	93, 565. 21	81, 414. 12
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		25, 186, 083. 25	1, 744, 493. 63
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		25, 186, 083. 25	1, 744, 493. 63
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		25, 186, 083. 25	1, 744, 493. 63

6.3 净资产变动表

会计主体：华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 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	127, 508, 978. 49	-	130, 080, 154. 91	257, 589, 133. 40
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	127, 508, 978. 49	-	130, 080, 154. 91	257, 589, 133. 40
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-16, 618, 092. 46	-	6, 154, 770. 20	-10, 463, 322. 26
（一）、综合收益总额	-	-	25, 186, 083. 25	25, 186, 083. 25
（二）、本期基	-16, 618, 092. 46	-	-19, 031, 313. 05	-35, 649, 405. 51

金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）				
其中：1. 基金申购款	1,979,705.46	-	2,153,019.40	4,132,724.86
2. 基金赎回款	-18,597,797.92	-	-21,184,332.45	-39,782,130.37
（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	110,890,886.03	-	136,234,925.11	247,125,811.14
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	48,737,726.56	-	34,506,111.63	83,243,838.19
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	48,737,726.56	-	34,506,111.63	83,243,838.19
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	83,031,111.04	-	57,167,116.37	140,198,227.41
（一）、综合收益总额	-	-	1,744,493.63	1,744,493.63
（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）	83,031,111.04	-	55,422,622.74	138,453,733.78

其中：1. 基金申购款	132,883,753.06	-	88,800,800.28	221,684,553.34
2. 基金赎回款	-49,852,642.02	-	-33,378,177.54	-83,230,819.56
（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	131,768,837.60	-	91,673,228.00	223,442,065.60

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：

向辉

基金管理人负责人

李孟恒

主管会计工作负责人

张幸骏

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金（原名为华宝兴业新价值灵活配置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[2015]第 799 号《关于准予华宝兴业新价值灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，由华宝基金管理有限公司（原华宝兴业基金管理有限公司，已于 2017 年 10 月 17 日办理完成工商变更登记）依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业新价值灵活配置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 1,951,610,868.52 元，业经安永华明中天会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2015)验字第 60737318_B22 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华宝兴业新价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 1 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,951,656,311.50 份基金份额，其中认购资金利息折合 45,442.98 份基金份额。本基金的基金管理人为华宝基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《华宝基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》，华宝兴业新价值灵活配置混合

型证券投资基金于 2017 年 12 月 30 日起更名为华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝新价值灵活配置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（包括中小板、创业板、存托凭证和其他经中国证监会核准上市的股票）、固定收益品种和货币市场工具（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、质押及买断式回购、银行存款、大额存单等）、股指期货、权证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）。本基金的股票投资比例不低于基金资产的 0%-95%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，持有现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：1 年期银行定期存款基准利率（税后）+3%。

本财务报表由本基金的基金管理人华宝基金管理有限公司于 2026 年 8 月 27 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

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 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净资产变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

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》、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》、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，截至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) 对本基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、

红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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。

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。

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。

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	1,403,141.68
等于：本金	1,403,030.72
加：应计利息	110.96
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	1,403,141.68

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		172,218,991.75	-	210,810,673.17	38,591,681.42
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	3,302,645.00	23,868.17	3,327,658.17	1,145.00
	银行间市场	10,091,530.00	92,205.48	10,179,205.48	-4,530.00
	合计	13,394,175.00	116,073.65	13,506,863.65	-3,385.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		185,613,166.75	116,073.65	224,317,536.82	38,588,296.42

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	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	22,825,968.00	-	-	-
其中：股指期货投资	22,825,968.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	22,825,968.00	-	-	-

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
IF2607	IF2607	4.00	5,906,400.00	69,792.00
IF2609	IF2609	7.00	10,184,580.00	299,100.00

IF2612	IF2612	5.00	7,142,100.00	38,220.00
合计				407,112.00
减:可抵销期货暂收款				407,112.00
净额				0.00

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/其他衍生工具为国债/股指/商品期货投资，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股指/商品/国债期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指/商品/国债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	13,769,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	13,769,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有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	13.45
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	45,993.77
其中：交易所市场	45,643.77
银行间市场	350.00
应付利息	-
预提费用	71,408.12
合计	117,415.34

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	127,508,978.49	127,508,978.49
本期申购	1,979,705.46	1,979,705.46
本期赎回（以“-”号填列）	-18,597,797.92	-18,597,797.92
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	110,890,886.03	110,890,886.03

注：申购含红利再投以及转换入份(金)额，赎回含转换出份(金)额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	96,135,209.03	33,944,945.88	130,080,154.91
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	96,135,209.03	33,944,945.88	130,080,154.91
本期利润	16,562,138.26	8,623,944.99	25,186,083.25
本期基金份额交易产生的变动数	-13,621,051.17	-5,410,261.88	-19,031,313.05
其中：基金申购款	1,594,358.67	558,660.73	2,153,019.40
基金赎回款	-15,215,409.84	-5,968,922.61	-21,184,332.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	99,076,296.12	37,158,628.99	136,234,925.11

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	958.17
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	13,991.64
其他	33.54
合计	14,983.35

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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	65,635,291.32
减：卖出股票成本总额	53,297,495.46
减：交易费用	81,547.93
买卖股票差价收入	12,256,247.93

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1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	100,455.23
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-26,955.28
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	73,499.95

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1月1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	24,000,048.89
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	23,627,605.28
减：应计利息总额	399,048.89
减：交易费用	350.00
买卖债券差价收入	-26,955.28

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——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

6.4.7.13.1 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	3,007,061.06

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,183,456.30
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	2,183,456.30

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	9,103,872.99
股票投资	9,086,663.51
债券投资	17,209.48
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-479,928.00
权证投资	-
期货投资	-479,928.00
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	8,623,944.99

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	30,548.80
基金转换费收入	1,052.89
合计	31,601.69

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	11,900.75
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	3,557.09
账户维护费	18,000.00
上清所 CFCA 证书服务费	600.00
合计	93,565.21

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无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
华宝基金管理有限公司(“华宝基金”)	基金管理人, 注册登记机构, 基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人, 基金销售机构
华宝信托有限责任公司(“华宝信托”)	基金管理人的股东
华平资产管理有限合伙(Warburg Pincus Asset Management.L.P.)	基金管理人的股东
江苏省铁路集团有限公司(“江苏铁集”)	基金管理人的股东
中国宝武钢铁集团有限公司(“宝武集团”)	华宝信托的最终控制人
华宝证券股份有限公司(“华宝证券”)	受宝武集团控制的公司, 基金销售机构
华宝投资有限公司(“华宝投资”)	受宝武集团控制的公司
宝武集团财务有限责任公司(“宝武财务”)	受宝武集团控制的公司

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	746,522.55	527,571.74
其中：应支付销售机构的客户维护费	131,610.93	116,359.75
应支付基金管理人的净管理费	614,911.62	411,211.99

注：支付基金管理人华宝基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.6%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 ×0.6% / 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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	248,840.77	175,857.24

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.2%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.2% / 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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

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

份额单位：份

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------	--

	月 30 日	6 月 30 日
基金合同生效日（2015 年 6 月 1 日）持有的基金份额	—	—
报告期初持有的基金份额	—	6,498,765.11
报告期间申购/买入总份额	—	0.00
报告期间因拆分变动份额	—	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	—	0.00
报告期末持有的基金份额	—	6,498,765.11
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	—	4.93%

注：基金管理人投资本基金适用的认（申）购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

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

本报告期末及上年度末除基金管理人外其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	1,403,141.68	958.17	306,768.76	6,177.02

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证 券 名 称	成 功 认 购 日	受 限 期	流 通 受 限	认 购 价 格	期 末 估 值 单 价	数 量 （ 单 位： 股）	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注

				类型						
001220	世盟股份	2026年1月27日	6个月	新股锁定	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001237	惠康科技	2026年5月15日	6个月	新股锁定	53.26	58.74	109	5,805.34	6,402.66	-
001248	华润新能源	2026年6月24日	1个月内(含)	新股流通受限	10.11	10.11	3,767	38,084.37	38,084.37	-
001248	华润新能源	2026年6月24日	6个月	新股锁定	10.11	10.11	8,792	88,887.12	88,887.12	-
001257	盛龙股份	2026年3月24日	6个月	新股锁定	7.82	20.74	1,046	8,179.72	21,694.04	-
001312	福恩股份	2026年4月14日	6个月	新股锁定	18.38	16.78	93	1,709.34	1,560.54	-
001365	天海电子	2026年5月11日	6个月	新股锁定	27.19	31.31	268	7,286.92	8,391.08	-
001393	维通利	2026年5月8日	6个月	新股锁定	30.38	38.99	188	5,711.44	7,330.12	-
001399	惠科股份	2026年6月16日	6个月	新股锁定	10.12	27.73	1,369	13,854.28	37,962.37	-
301513	尚水智	2026年4月10日	6个月	新股锁	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-

	能	日		定						
301531	春光集团	2026年4月28日	6个月	新股锁定	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026年4月22日	6个月	新股锁定	13.91	32.47	317	4,409.47	10,292.99	-
301666	大普微	2026年4月8日	6个月	新股锁定	46.08	463.33	384	17,694.72	177,918.72	-
301669	高特电子	2026年6月2日	6个月	新股锁定	7.08	28.40	543	3,844.44	15,421.20	-
301680	固德电材	2026年2月27日	6个月	新股锁定	58.00	112.16	82	4,756.00	9,197.12	-
301682	宏明电子	2026年3月18日	6个月	新股锁定	69.66	160.06	233	16,230.78	37,293.98	-
301683	慧谷新材	2026年3月24日	6个月	新股锁定	78.38	121.77	56	4,389.28	6,819.12	-
301687	新广益	2025年12月24日	6个月	新股锁定	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301696	三瑞智能	2026年3月31日	6个月	新股锁定	24.68	86.80	162	3,998.16	14,061.60	-
601112	振石股份	2026年1月21日	6个月	新股锁定	11.18	17.59	246	2,750.28	4,327.14	-
603284	林平发	2026年2月3日	6个月	新股锁	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-

	展	日		定						
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股 锁定	33.49	33.93	46	1,540.54	1,560.78	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股 锁定	21.88	25.52	89	1,947.32	2,271.28	-
603407	长裕集团	2026 年 4 月 29 日	6 个月	新股 锁定	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股 锁定	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	新股 锁定	40.98	308.19	116	4,753.68	35,750.04	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股 锁定	17.52	35.92	1,075	18,834.00	38,614.00	-
688759	必贝特	2025 年 10 月 21 日	9 个月	新股 锁定	17.78	30.65	6,015	106,946.70	184,359.75	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股 锁定	92.18	463.15	67	6,176.06	31,031.05	-
688790	昂瑞微	2025 年 12 月 9 日	9 个月	新股 锁定	83.06	126.45	783	65,035.98	99,010.35	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股 锁定	44.56	468.67	101	4,500.56	47,335.67	-
688802	沐曦股	2025 年 12 月 9	9 个月	新股锁	104.66	768.89	699	73,157.34	537,454.11	-

	份	日		定						
688808	联讯仪器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新股锁定	81.88	1,584.33	63	5,158.44	99,812.79	-
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定	26.28	172.09	192	5,045.76	33,041.28	-
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股锁定	55.95	57.10	106	5,930.70	6,052.60	-
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股锁定	9.47	70.14	770	7,291.90	54,007.80	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁定	19.68	141.49	373	7,340.64	52,775.77	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	832.00	2026 年 7 月 13 日	890.99	1,300	798,474.60	1,081,600.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购，因此没有在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购，因此没有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

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

本基金是一只混合型证券投资基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票、债券等。本基金在日常经营活动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设，公司内部监督和反馈系统包括内部控制委员会、督察长、合规审计部、风险管理部、各部门负责人和风险控制联络人、各业务岗位。内部控制委员会负责对公司在经营管理和基金运作中的风险进行评估并研究制订相应的控制制度。督察长向董事会负责，总管公司的内控事务并独立地就内控制度的执行情况履行检查、评价、报告和建议职能。风险管理部在督察长指导下对公司内部控制运行情况进行监控，主要针对公司内部控制制度的总体构架和内部控制的目标进行评估并提出改进意见；合规审计部在督察长的领导下对各部门和岗位的内部控制执行情况进行监督和核查，同时对内控的失控点进行查漏并责令改正。

本基金的基金管理人根据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的四层监控防线。第一层监控防线为一线岗位自控与互控；第二层防线为大业务板块内部各部门和部门之间的自控和互控；第三层监控防线为风险管理部和合规审计部对各岗位、各部门、各项业务全面实施的监督反馈；最后是以内部控制委员会为主体的第四层防线，实施对公司各类业务和风险的总体监督、控制，并对风险管理部和合规审计部的工作予以直接指导。

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

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债券和资产支持证券占基金净资产的比例较低（含债券投资比例为零），因此无重大信用风险（上年度末：同）。

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，除附注中列示的卖出回购金融资产款将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。（上年度末：同）

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、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上

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%。

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。

本报告期内，基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理。本基金所持大部分证券在证券交易所上市或银行间同业市场交易，不存在具有重大流动性风险的投资品种。

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；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。综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有货币资金、结

算备付金、存出保证金和买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

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	1,403,141.68	-	-	-	1,403,141.68
结算备付金	5,192,271.26	-	-	-	5,192,271.26
存出保证金	20,997.82	-	-	2,787,969.60	2,808,967.42
交易性金融资产	13,506,863.65	-	-	210,810,673.17	224,317,536.82
买入返售金融资产	13,769,000.00	-	-	-	13,769,000.00
应收申购款	-	-	-	58,949.12	58,949.12
应收清算款	-	-	-	161,049.05	161,049.05
资产总计	33,892,274.41	-	-	213,818,640.94	247,710,915.35
负债					
应付赎回款	-	-	-	267,511.90	267,511.90
应付管理人报酬	-	-	-	122,298.36	122,298.36
应付托管费	-	-	-	40,766.12	40,766.12
应交税费	-	-	-	37,112.49	37,112.49
其他负债	-	-	-	117,415.34	117,415.34
负债总计	-	-	-	585,104.21	585,104.21
利率敏感度缺口	33,892,274.41	-	-	213,233,536.73	247,125,811.14
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	201,216.02	-	-	-	201,216.02
结算备付金	4,310,269.73	-	-	-	4,310,269.73
存出保证金	35,705.02	-	-	2,652,940.80	2,688,645.82
交易性金融资产	13,403,899.15	-	-	221,895,448.40	235,299,347.55
买入返售金融资产	15,514,667.39	-	-	-	15,514,667.39
应收申购款	-	-	-	104,633.63	104,633.63
应收清算款	-	-	-	142,905.74	142,905.74
资产总计	33,465,757.31	-	-	224,795,928.57	258,261,685.88
负债					
应付赎回款	-	-	-	88,084.04	88,084.04
应付管理人报酬	-	-	-	129,987.52	129,987.52
应付托管费	-	-	-	43,329.17	43,329.17
应付清算款	-	-	-	143,542.46	143,542.46
应交税费	-	-	-	47,739.03	47,739.03
其他负债	-	-	-	219,870.26	219,870.26
负债总计	-	-	-	672,552.48	672,552.48
利率敏感度缺口	33,465,757.31	-	-	224,123,376.09	257,589,133.40

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

者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金持有交易性债券投资比例较低(上年度末：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(上年度末：同)。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的 0%-95%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	210,810,673.17	85.30	221,895,448.40	86.14
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	210,810,673.17	85.30	221,895,448.40	86.14

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资，在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间抵销后的净额为 0。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	1. 沪深 300 指数上升 5%	11,617,431.48	10,398,892.78
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-11,617,431.48	-10,398,892.78

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	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	207,965,090.41	219,019,986.94
第二层次	14,715,435.14	15,126,842.15
第三层次	1,637,011.27	1,152,518.46

合计	224,317,536.82	235,299,347.55
----	----------------	----------------

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的证券等，若出现重大事项停牌、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将相关证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，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	210,810,673.17	85.10
	其中：股票	210,810,673.17	85.10
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	13,506,863.65	5.45
	其中：债券	13,506,863.65	5.45
	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	13,769,000.00	5.56
	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	6,595,412.94	2.66
8	其他各项资产	3,028,965.59	1.22
9	合计	247,710,915.35	100.00

注：本基金本报告期末“固定收益投资”、“买入返售金融资产”、“银行存款和结算备付金合计”等项目的列报金额已包含对应的“应计利息”和“减值准备”（若有），“其他资产”中的“应收

利息”指本基金截至本报告期末已过付息期但尚未收到的利息金额（下同）。

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	1,097,339.00	0.44
B	采矿业	8,785,173.14	3.55
C	制造业	135,583,247.02	54.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,235,708.10	2.12
E	建筑业	2,369,963.00	0.96
F	批发和零售业	338,161.00	0.14
G	交通运输、仓储和邮政业	5,097,772.46	2.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,969,885.35	4.44
J	金融业	37,157,465.10	15.04
K	房地产业	632,394.00	0.26
L	租赁和商务服务业	834,693.00	0.34
M	科学研究和技术服务业	2,353,239.00	0.95
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	250,278.00	0.10
R	文化、体育和娱乐业	105,355.00	0.04
S	综合	-	-
	合计	210,810,673.17	85.30

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	8,200	10,414,000.00	4.21
2	300750	宁德时代	20,040	7,875,920.40	3.19
3	300502	新易盛	10,704	6,497,328.00	2.63
4	600519	贵州茅台	4,801	5,691,537.49	2.30
5	603986	兆易创新	6,100	4,971,500.00	2.01

6	601318	中国平安	101,900	4,864,706.00	1.97
7	688256	寒武纪	2,357	3,760,711.35	1.52
8	002371	北方华创	4,030	3,564,776.80	1.44
9	688012	中微公司	6,658	3,119,273.00	1.26
10	601899	紫金矿业	123,500	3,104,790.00	1.26
11	600036	招商银行	84,300	2,992,650.00	1.21
12	002475	立讯精密	40,866	2,876,966.40	1.16
13	000333	美的集团	37,200	2,809,716.00	1.14
14	688981	中芯国际	17,400	2,763,468.00	1.12
15	600900	长江电力	93,200	2,467,004.00	1.00
16	600030	中信证券	82,770	2,377,982.10	0.96
17	603259	药明康德	18,900	2,353,239.00	0.95
18	688008	澜起科技	7,400	2,293,260.00	0.93
19	000725	京东方 A	260,400	2,260,272.00	0.91
20	688041	海光信息	6,000	2,221,800.00	0.90
21	600183	生益科技	12,800	2,219,520.00	0.90
22	601138	工业富联	30,400	2,193,360.00	0.89
23	002384	东山精密	8,300	2,177,505.00	0.88
24	601398	工商银行	296,100	2,093,427.00	0.85
25	300059	东方财富	94,200	1,919,796.00	0.78
26	601166	兴业银行	115,400	1,911,024.00	0.77
27	601328	交通银行	295,800	1,901,994.00	0.77
28	600276	恒瑞医药	33,700	1,753,748.00	0.71
29	300408	三环集团	10,100	1,685,690.00	0.68
30	300274	阳光电源	10,480	1,666,529.60	0.67
31	601288	农业银行	271,500	1,648,005.00	0.67
32	603019	中科曙光	14,300	1,533,389.00	0.62
33	002594	比亚迪	18,400	1,466,480.00	0.59
34	000338	潍柴动力	51,300	1,397,925.00	0.57
35	300476	胜宏科技	4,000	1,385,720.00	0.56
36	600919	江苏银行	128,400	1,384,152.00	0.56
37	601211	国泰海通	73,300	1,334,060.00	0.54
38	002463	沪电股份	8,700	1,329,360.00	0.54
39	000651	格力电器	33,900	1,271,250.00	0.51
40	300394	天孚通信	4,172	1,262,780.96	0.51
41	000988	华工科技	6,500	1,199,965.00	0.49
42	600176	中国巨石	15,600	1,136,928.00	0.46
43	301308	江波龙	1,600	1,126,080.00	0.46
44	600584	长电科技	10,700	1,107,985.00	0.45
45	688072	拓荆科技	1,300	1,081,600.00	0.44
46	600887	伊利股份	44,900	1,075,804.00	0.44
47	600522	中天科技	17,700	1,074,036.00	0.43
48	688521	芯原股份	2,800	1,039,192.00	0.42

49	603993	洛阳钼业	56,600	993,330.00	0.40
50	600150	中国船舶	29,300	990,047.00	0.40
51	601939	建设银行	102,000	982,260.00	0.40
52	601816	京沪高铁	212,600	963,078.00	0.39
53	002415	海康威视	28,000	957,600.00	0.39
54	300124	汇川技术	14,100	935,253.00	0.38
55	000858	五粮液	12,600	932,400.00	0.38
56	601688	华泰证券	43,400	894,908.00	0.36
57	601088	中国神华	22,500	878,400.00	0.36
58	601668	中国建筑	198,000	859,320.00	0.35
59	601857	中国石油	98,100	851,508.00	0.34
60	600999	招商证券	40,000	844,000.00	0.34
61	600309	万华化学	12,200	834,602.00	0.34
62	002916	深南电路	1,790	819,641.00	0.33
63	600941	中国移动	9,400	809,622.00	0.33
64	600406	国电南瑞	35,400	808,890.00	0.33
65	002142	宁波银行	26,800	795,692.00	0.32
66	600111	北方稀土	16,400	788,020.00	0.32
67	600031	三一重工	45,400	784,512.00	0.32
68	000100	TCL 科技	134,670	783,779.40	0.32
69	600000	浦发银行	90,700	780,927.00	0.32
70	000063	中兴通讯	20,900	756,371.00	0.31
71	600089	特变电工	32,800	738,000.00	0.30
72	002050	三花智控	16,400	718,812.00	0.29
73	000708	中信特钢	55,600	701,672.00	0.28
74	300433	蓝思科技	12,900	692,214.00	0.28
75	002028	思源电气	4,000	692,000.00	0.28
76	000001	平安银行	66,000	663,300.00	0.27
77	601229	上海银行	75,100	651,868.00	0.26
78	300014	亿纬锂能	9,900	643,797.00	0.26
79	601919	中远海控	47,000	623,220.00	0.25
80	000792	盐湖股份	20,600	621,914.00	0.25
81	601728	中国电信	119,700	621,243.00	0.25
82	002714	牧原股份	17,700	619,323.00	0.25
83	601628	中国人寿	17,500	618,625.00	0.25
84	600549	厦门钨业	7,200	613,440.00	0.25
85	002353	杰瑞股份	4,000	610,000.00	0.25
86	000977	浪潮信息	8,700	609,000.00	0.25
87	600690	海尔智家	29,400	600,054.00	0.24
88	600660	福耀玻璃	11,700	590,148.00	0.24
89	300760	迈瑞医疗	4,300	584,069.00	0.24
90	000657	中钨高新	5,900	564,748.00	0.23
91	601012	隆基绿能	42,900	562,848.00	0.23

92	601225	陕西煤业	27,500	559,625.00	0.23
93	300033	同花顺	2,320	559,120.00	0.23
94	002938	鹏鼎控股	5,300	558,514.00	0.23
95	600016	民生银行	169,400	545,468.00	0.22
96	002602	世纪华通	38,200	538,620.00	0.22
97	688802	沐曦股份	699	537,454.11	0.22
98	600938	中国海油	19,300	523,995.00	0.21
99	603501	豪威集团	5,500	521,675.00	0.21
100	002230	科大讯飞	12,600	514,584.00	0.21
101	600926	杭州银行	34,600	499,970.00	0.20
102	000425	徐工机械	61,700	499,153.00	0.20
103	601169	北京银行	101,000	494,900.00	0.20
104	002352	顺丰控股	15,600	487,656.00	0.20
105	601985	中国核电	53,300	481,299.00	0.19
106	300498	温氏股份	38,800	478,016.00	0.19
107	002460	赣锋锂业	7,300	477,420.00	0.19
108	002709	天赐材料	9,200	473,156.00	0.19
109	603799	华友钴业	9,800	472,948.00	0.19
110	600160	巨化股份	8,800	466,488.00	0.19
111	000776	广发证券	19,100	446,940.00	0.18
112	300442	润泽科技	5,300	440,271.00	0.18
113	000938	紫光股份	15,100	435,786.00	0.18
114	601100	恒立液压	4,000	430,240.00	0.17
115	002202	金风科技	17,900	427,810.00	0.17
116	688126	沪硅产业	10,700	426,823.00	0.17
117	601600	中国铝业	51,500	423,330.00	0.17
118	600028	中国石化	94,500	421,470.00	0.17
119	002241	歌尔股份	18,500	416,805.00	0.17
120	601009	南京银行	42,100	416,369.00	0.17
121	600460	士兰微	7,600	415,416.00	0.17
122	600958	东方证券	43,900	414,416.00	0.17
123	002600	领益智造	23,700	410,958.00	0.17
124	002466	天齐锂业	6,700	410,844.00	0.17
125	601766	中国中车	78,900	410,280.00	0.17
126	600050	中国联通	101,400	405,600.00	0.16
127	300661	圣邦股份	2,800	401,744.00	0.16
128	002837	英维克	5,035	400,584.60	0.16
129	002049	紫光国微	4,400	390,500.00	0.16
130	000807	云铝股份	17,500	387,450.00	0.16
131	002179	中航光电	8,200	378,840.00	0.15
132	000568	泸州老窖	4,800	372,096.00	0.15
133	601658	邮储银行	75,000	369,750.00	0.15
134	600066	宇通客车	13,700	367,297.00	0.15

135	601872	招商轮船	20,900	367,213.00	0.15
136	601818	光大银行	126,400	365,296.00	0.15
137	688111	金山办公	1,700	362,185.00	0.15
138	000975	山金国际	21,300	362,100.00	0.15
139	603288	海天味业	10,800	358,128.00	0.14
140	601006	大秦铁路	77,200	355,892.00	0.14
141	002001	新 和 成	12,500	355,250.00	0.14
142	000408	藏格矿业	5,100	353,532.00	0.14
143	605117	德业股份	3,320	352,517.60	0.14
144	600809	山西汾酒	3,200	349,984.00	0.14
145	688082	盛美上海	800	345,600.00	0.14
146	600905	三峡能源	92,800	344,288.00	0.14
147	600760	中航沈飞	8,320	341,952.00	0.14
148	600489	中金黄金	18,900	341,145.00	0.14
149	002625	光启技术	11,200	339,584.00	0.14
150	601888	中国中免	6,300	338,373.00	0.14
151	600893	航发动力	8,700	333,558.00	0.13
152	601689	拓普集团	5,900	332,878.00	0.13
153	000630	铜陵有色	52,200	331,992.00	0.13
154	601127	赛力斯	5,300	324,625.00	0.13
155	688396	华润微	3,300	321,915.00	0.13
156	002027	分众传媒	65,600	317,504.00	0.13
157	688271	联影医疗	3,100	313,813.00	0.13
158	600118	中国卫星	3,800	311,790.00	0.13
159	601838	成都银行	17,300	306,210.00	0.12
160	000166	申万宏源	67,100	295,240.00	0.12
161	002648	卫星化学	12,500	293,625.00	0.12
162	688183	生益电子	2,200	291,280.00	0.12
163	600104	上汽集团	29,800	290,848.00	0.12
164	600346	恒力石化	16,400	290,444.00	0.12
165	600362	江西铜业	6,700	290,110.00	0.12
166	300450	先导智能	7,100	289,112.00	0.12
167	601727	上海电气	40,900	286,300.00	0.12
168	600875	东方电气	9,900	284,823.00	0.12
169	600989	宝丰能源	13,800	280,554.00	0.11
170	002422	科伦药业	7,200	277,344.00	0.11
171	600015	华夏银行	43,400	277,326.00	0.11
172	601390	中国中铁	66,500	277,305.00	0.11
173	000538	云南白药	5,800	274,746.00	0.11
174	601995	中金公司	7,600	274,740.00	0.11
175	603296	华勤技术	3,680	273,313.60	0.11
176	600795	国电电力	58,000	270,860.00	0.11
177	601377	兴业证券	44,800	270,592.00	0.11

178	600547	山东黄金	11,700	270,153.00	0.11
179	601916	浙商银行	102,600	269,838.00	0.11
180	000933	神火股份	12,700	269,240.00	0.11
181	600585	海螺水泥	15,600	264,420.00	0.11
182	603893	瑞芯微	1,400	263,704.00	0.11
183	000157	中联重科	37,800	263,466.00	0.11
184	601669	中国电建	55,900	262,730.00	0.11
185	300316	晶盛机电	4,200	253,680.00	0.10
186	600886	国投电力	19,000	252,890.00	0.10
187	601998	中信银行	36,200	250,866.00	0.10
188	600674	川投能源	17,700	250,809.00	0.10
189	300015	爱尔眼科	30,300	250,278.00	0.10
190	600741	华域汽车	16,100	249,872.00	0.10
191	601698	中国卫通	8,200	248,050.00	0.10
192	688036	传音控股	4,200	247,590.00	0.10
193	600350	山东高速	22,000	244,860.00	0.10
194	601066	中信建投	8,400	244,188.00	0.10
195	601868	中国能建	91,000	242,970.00	0.10
196	600482	中国动力	7,400	242,720.00	0.10
197	600188	兖矿能源	13,430	238,651.10	0.10
198	002558	巨人网络	8,600	237,016.00	0.10
199	002311	海大集团	5,300	236,433.00	0.10
200	300418	昆仑万维	5,800	234,088.00	0.09
201	000625	长安汽车	32,130	230,372.10	0.09
202	600221	海航控股	166,600	224,910.00	0.09
203	600426	华鲁恒升	9,400	224,848.00	0.09
204	000895	双汇发展	10,000	224,000.00	0.09
205	601077	渝农商行	36,100	220,571.00	0.09
206	300803	指南针	2,400	220,008.00	0.09
207	600436	片仔癀	2,000	218,560.00	0.09
208	605499	东鹏饮料	1,750	216,002.50	0.09
209	600048	保利发展	46,600	215,758.00	0.09
210	600011	华能国际	28,100	213,279.00	0.09
211	002236	大华股份	12,900	212,721.00	0.09
212	002532	天山铝业	19,800	212,454.00	0.09
213	600438	通威股份	17,500	211,925.00	0.09
214	600570	恒生电子	10,000	211,900.00	0.09
215	600115	中国东航	55,300	210,693.00	0.09
216	002493	荣盛石化	19,400	208,550.00	0.08
217	000963	华东医药	7,300	205,276.00	0.08
218	601360	三六零	23,200	201,608.00	0.08
219	600285	羚锐制药	10,400	201,552.00	0.08
220	688047	龙芯中科	1,300	201,071.00	0.08

221	003816	中国广核	51,100	199,801.00	0.08
222	002736	国信证券	20,000	199,800.00	0.08
223	601058	赛轮轮胎	17,000	196,010.00	0.08
224	000301	东方盛虹	17,100	195,795.00	0.08
225	002895	川恒股份	6,700	195,640.00	0.08
226	600026	中远海能	10,800	193,752.00	0.08
227	601901	方正证券	26,800	192,960.00	0.08
228	002074	国轩高科	7,000	192,570.00	0.08
229	600009	上海机场	8,100	187,110.00	0.08
230	000768	中航西飞	9,100	186,368.00	0.08
231	688759	必贝特	6,015	184,359.75	0.07
232	600196	复星医药	8,200	184,254.00	0.07
233	001979	招商蛇口	28,600	183,898.00	0.07
234	601788	光大证券	12,600	181,818.00	0.07
235	600029	南方航空	35,000	181,300.00	0.07
236	601456	国联民生	20,400	180,336.00	0.07
237	600219	南山铝业	44,900	179,151.00	0.07
238	600415	小商品城	17,600	178,816.00	0.07
239	301666	大普微	384	177,918.72	0.07
240	601186	中国铁建	29,800	177,310.00	0.07
241	601881	中国银河	14,100	177,237.00	0.07
242	601319	中国人保	26,000	175,760.00	0.07
243	600233	圆通速递	11,100	174,825.00	0.07
244	601117	中国化学	23,700	174,195.00	0.07
245	301236	软通动力	4,100	174,045.00	0.07
246	300395	菲利华	1,300	173,849.00	0.07
247	600312	平高电气	9,800	173,068.00	0.07
248	601877	正泰电器	6,800	170,476.00	0.07
249	600372	中航机载	15,600	169,260.00	0.07
250	601878	浙商证券	17,800	169,100.00	0.07
251	301269	华大九天	1,400	167,188.00	0.07
252	002920	德赛西威	2,000	163,000.00	0.07
253	601111	中国国航	25,000	151,250.00	0.06
254	600141	兴发集团	3,200	150,304.00	0.06
255	688506	百利天恒	510	149,955.30	0.06
256	600012	皖通高速	9,400	148,144.00	0.06
257	300866	安克创新	1,400	146,300.00	0.06
258	601021	春秋航空	3,200	145,856.00	0.06
259	002304	洋河股份	3,800	144,970.00	0.06
260	601898	中煤能源	11,900	144,942.00	0.06
261	600023	浙能电力	25,900	136,234.00	0.06
262	600039	四川路桥	16,900	132,158.00	0.05
263	601800	中国交建	22,900	130,759.00	0.05

264	000002	万 科 A	44,100	130,536.00	0.05
265	001248	华润新能源	12,559	126,971.49	0.05
266	688223	晶科能源	26,600	126,350.00	0.05
267	600588	用友网络	13,600	124,848.00	0.05
268	601633	长城汽车	8,100	122,229.00	0.05
269	001965	招商公路	13,200	120,912.00	0.05
270	600600	青岛啤酒	2,300	120,129.00	0.05
271	002126	银轮股份	2,400	119,520.00	0.05
272	600027	华电国际	25,700	114,365.00	0.05
273	603369	今世缘	4,800	113,808.00	0.05
274	601618	中国中冶	46,400	113,216.00	0.05
275	600879	航天电子	5,300	112,837.00	0.05
276	300628	亿联网络	3,300	111,606.00	0.05
277	603260	合盛硅业	2,300	110,998.00	0.04
278	601607	上海医药	7,200	110,880.00	0.04
279	302132	中航成飞	1,900	110,808.00	0.04
280	603699	纽威股份	2,200	110,660.00	0.04
281	600750	华润江中	5,000	110,350.00	0.04
282	600918	中泰证券	20,600	109,592.00	0.04
283	600061	国投资本	16,700	109,385.00	0.04
284	000617	中油资本	16,400	108,076.00	0.04
285	600025	华能水电	12,100	107,569.00	0.04
286	000429	粤高速 A	7,800	106,470.00	0.04
287	300251	光线传媒	9,500	105,355.00	0.04
288	300832	新产业	2,500	105,000.00	0.04
289	600930	华电新能	21,793	103,952.61	0.04
290	688472	阿特斯	9,500	102,790.00	0.04
291	600515	海南机场	37,300	102,202.00	0.04
292	601059	信达证券	6,300	101,997.00	0.04
293	600085	同仁堂	4,400	101,684.00	0.04
294	688808	联讯仪器	63	99,812.79	0.04
295	688790	昂瑞微	783	99,010.35	0.04
296	688187	时代电气	1,400	96,124.00	0.04
297	603920	世运电路	2,000	96,080.00	0.04
298	000999	华润三九	4,250	95,582.50	0.04
299	600803	新奥股份	6,000	94,800.00	0.04
300	600018	上港集团	19,500	92,040.00	0.04
301	300122	智飞生物	7,800	91,182.00	0.04
302	300999	金龙鱼	3,900	90,714.00	0.04
303	000596	古井贡酒	1,100	87,780.00	0.04
304	300896	爱美客	1,000	87,200.00	0.04
305	600282	南钢股份	17,700	81,243.00	0.03
306	688009	中国通号	16,800	79,968.00	0.03

307	601018	宁波港	25,000	78,750.00	0.03
308	001280	中国铀业	1,100	73,370.00	0.03
309	601238	广汽集团	14,400	73,152.00	0.03
310	301165	锐捷网络	900	72,405.00	0.03
311	600642	申能股份	8,200	71,586.00	0.03
312	688303	大全能源	4,100	71,463.00	0.03
313	002533	金杯电工	6,600	70,422.00	0.03
314	300413	芒果超媒	4,800	70,224.00	0.03
315	600737	中粮糖业	5,600	69,048.00	0.03
316	603392	万泰生物	2,500	67,425.00	0.03
317	002821	凯莱英	400	64,800.00	0.03
318	002271	东方雨虹	4,800	56,976.00	0.02
319	002043	兔宝宝	5,000	55,400.00	0.02
320	688818	电科蓝天	770	54,007.80	0.02
321	688820	盛合晶微	373	52,775.77	0.02
322	601136	首创证券	3,600	50,220.00	0.02
323	688797	臻宝科技	101	47,335.67	0.02
324	688712	北芯生命	1,075	38,614.00	0.02
325	001391	国货航	9,400	38,258.00	0.02
326	001399	惠科股份	1,369	37,962.37	0.02
327	301682	宏明电子	233	37,293.98	0.02
328	688635	长进光子	116	35,750.04	0.01
329	002601	龙佰集团	2,100	34,608.00	0.01
330	688813	泰金新能	192	33,041.28	0.01
331	688785	恒运昌	67	31,031.05	0.01
332	600479	千金药业	3,100	28,830.00	0.01
333	603368	柳药集团	1,500	22,005.00	0.01
334	001257	盛龙股份	1,046	21,694.04	0.01
335	301669	高特电子	543	15,421.20	0.01
336	301687	新广益	195	15,167.10	0.01
337	301531	春光集团	290	14,952.40	0.01
338	301696	三瑞智能	162	14,061.60	0.01
339	301599	理奇智能	317	10,292.99	0.00
340	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
341	301680	固德电材	82	9,197.12	0.00
342	001365	天海电子	268	8,391.08	0.00
343	001393	维通利	188	7,330.12	0.00
344	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
345	301683	慧谷新材	56	6,819.12	0.00
346	001237	惠康科技	109	6,402.66	0.00
347	688816	易思维	106	6,052.60	0.00
348	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
349	601112	振石股份	246	4,327.14	0.00

350	603352	至信股份	89	2,271.28	0.00
351	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
352	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
353	603293	埃泰克	46	1,560.78	0.00
354	001312	福恩股份	93	1,560.54	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000988	华工科技	1,100,650.00	0.43
2	601318	中国平安	953,266.00	0.37
3	301308	江波龙	919,868.00	0.36
4	300750	宁德时代	842,215.00	0.33
5	688256	寒武纪	805,740.00	0.31
6	688072	拓荆科技	798,474.60	0.31
7	300308	中际旭创	758,103.00	0.29
8	688521	芯原股份	663,600.00	0.26
9	601899	紫金矿业	635,026.00	0.25
10	002353	杰瑞股份	621,490.00	0.24
11	002602	世纪华通	598,018.00	0.23
12	600549	厦门钨业	474,957.00	0.18
13	300059	东方财富	461,702.00	0.18
14	000657	中钨高新	445,605.00	0.17
15	002202	金风科技	433,543.00	0.17
16	600519	贵州茅台	426,318.00	0.17
17	600036	招商银行	401,649.00	0.16
18	688008	澜起科技	396,952.00	0.15
19	300274	阳光电源	360,775.00	0.14
20	002475	立讯精密	359,044.00	0.14

注：买入金额不包括相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	2,313,400.00	0.90
2	300308	中际旭创	2,215,367.00	0.86
3	601318	中国平安	1,859,758.00	0.72
4	600519	贵州茅台	1,744,440.00	0.68
5	601899	紫金矿业	1,374,407.00	0.53
6	600036	招商银行	1,034,046.00	0.40
7	300502	新易盛	1,020,031.00	0.40
8	601211	国泰海通	914,856.62	0.36
9	000333	美的集团	883,984.00	0.34

10	688008	澜起科技	782,061.52	0.30
11	002475	立讯精密	765,622.00	0.30
12	603986	兆易创新	746,716.00	0.29
13	688256	寒武纪	744,341.25	0.29
14	600900	长江电力	695,175.00	0.27
15	300274	阳光电源	665,873.00	0.26
16	601166	兴业银行	598,058.00	0.23
17	688635	长进光子	583,581.86	0.23
18	601088	中国神华	569,317.00	0.22
19	688041	海光信息	565,266.00	0.22
20	002371	北方华创	545,273.00	0.21

注：卖出金额不包括相关交易费用。

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	33,126,056.72
卖出股票收入（成交）总额	65,635,291.32

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

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	3,225,153.59	1.31
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,281,710.06	4.16
	其中：政策性金融债	10,281,710.06	4.16
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	13,506,863.65	5.47

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	220203	22 国开 03	100,000	10,179,205.48	4.12
2	019827	26 国债 01	21,000	2,113,612.03	0.86
3	019792	25 国债 19	8,000	808,393.86	0.33
4	102317	国债 2519	3,000	303,147.70	0.12
5	018012	国开 2003	1,000	102,504.58	0.04

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

基金主要利用股指期货进行套期保值或仓位调节操作。当进行空头套期保值时，基金持有的卖出股指期货合约价值，不超过基金持有的股票总市值的 20%，基金通过空头套期保值，一定程度上可以规避市场的系统性风险。当进行多头仓位调节时，基金持有的买入股指期货合约价值，不超过基金资产净值的 10%，基金通过持有股指期货多头合约对股票资产进行替代，可以提高投资效率，赚取或有的基差收益和实现更好的头寸管理。截止报告期末，本基金对股指期货的投资符合基金合同的约定，符合既定的投资政策和投资目标。

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

本基金未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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

华宝新价值混合截止 2026 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，国家开发银行因违规经营，涉嫌违反相关法律法规，未依法履行其他职责，违反结汇、售汇及付汇管理规定；于 2025 年 07 月 25 日收到国家外汇管理局北京市分局警告，罚款，没收违法所得的处罚措施。

华宝新价值混合截止 2026 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，国家开发银行因违反金融统计管理规定；于 2025 年 09 月 30 日收到中国人民银行警告，罚款的处罚措施。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和他分析，认为上述处分不会对公司的投资价值构成实质性影响，因此本基金管理人上述证券的投资判断未发生改变。报告期内，本基金投资的前十名证券的其余的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 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

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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	2,808,967.42
2	应收清算款	161,049.05
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	58,949.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,028,965.59

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，合计数可能不等于分项之和。

§ 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

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 (%)
7,526	14,734.37	87,566,153.92	78.97	23,324,732.11	21.03

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
盈利投资者数量占比 (%)	97.79

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	314,023.42	0.2832

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 6 月 1 日） 基金份额总额	1,951,656,311.50
本报告期期初基金份额总额	127,508,978.49
本报告期基金总申购份额	1,979,705.46
减：本报告期基金总赎回份额	18,597,797.92
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	110,890,886.03

§ 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，基金管理人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产和基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：2024 年 10 月 23 日起至本报告期末。

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，基金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，基金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

10.6.4 托管人相关从业人员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(%)	
国海证券	2	14,750,895.52	15.14	6,430.30	15.14	—
华源证券	2	14,294,445.53	14.67	6,231.40	14.67	—
国联民生	5	12,330,155.21	12.65	5,374.97	12.65	—
中泰证券	1	11,682,387.19	11.99	5,092.36	11.99	—
东方财富	2	8,606,053.90	8.83	3,751.18	8.83	—
广发证券	4	7,926,132.77	8.13	3,455.40	8.13	—
申万宏源	3	5,796,710.78	5.95	2,526.93	5.95	—
东吴证券	2	5,536,955.84	5.68	2,413.55	5.68	—
国泰海通	3	4,477,071.72	4.59	1,951.74	4.59	—
华创证券	2	4,158,965.80	4.27	1,812.92	4.27	—
中信建投	2	3,469,006.55	3.56	1,512.14	3.56	—
东方证券	1	2,454,305.00	2.52	1,069.92	2.52	—
华泰证券	3	796,917.79	0.82	347.39	0.82	—
财通证券	3	524,938.93	0.54	228.78	0.54	—
中信证券	5	319,170.38	0.33	139.10	0.33	—
天风证券	4	302,751.00	0.31	131.92	0.31	—
麦高证券	2	21,220.98	0.02	9.26	0.02	—
长江证券	1	4,484.15	0.00	1.95	0.00	—
长城证券	2	—	—	—	—	—
诚通证券	1	—	—	—	—	—
大和证券	1	—	—	—	—	—

德邦证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
华兴证券	2	-	-	-	-	-
金融街证 券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证 券	1	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	4	-	-	-	-	-
浙商证券	3	-	-	-	-	-
中金国际	2	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
中邮证券	1	-	-	-	-	-
甬兴证券	2	-	-	-	-	-

注：1、基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

（1）选择标准：资金雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的要求。

需要，并能为本基金提供全面的信息服务；研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；适当的地域分散化。

(2) 选择程序:根据证监会《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》和公司《公募基金及私募资产管理计划专用交易席位管理办法》的要求，公司与符合前述标准的证券公司，签订《证券交易单元租用协议》，参与证券交易。

2、本报告期租用的证券公司交易单元新增的有：国盛证券、麦高证券、天风证券；退租交易单元：广发证券、国联民生证券。

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 (%)
国海证券	703,604.72	18.92	100,054,000.00	6.63	-	-
华源证券	304,182.06	8.18	312,066,000.00	20.68	-	-
国联民生	-	-	34,037,000.00	2.26	-	-
中泰证券	-	-	91,574,000.00	6.07	-	-
东方财富	1,600,002.40	43.03	150,910,000.00	10.00	-	-
广发证券	708,044.02	19.04	201,258,000.00	13.34	-	-
申万宏源	-	-	125,045,000.00	8.29	-	-
东吴证券	100,870.36	2.71	143,851,000.00	9.53	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	41,355,000.00	2.74	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	78,346,000.00	5.19	-	-

财通证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	54,685,000.00	3.62	-	-
天风证券	301,453.19	8.11	56,383,000.00	3.74	-	-
麦高证券	-	-	40,760,000.00	2.70	-	-
长江证券	-	-	53,890,000.00	3.57	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
大和证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
华兴证券	-	-	-	-	-	-
金融街证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-

五矿证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	24,975,000.00	1.65	-	-
中金国际	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-
甬兴证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华宝基金关于旗下部分基金新增万和证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2026-01-16
2	华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2026-01-22
3	华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金 2025 年年度报告	基金管理人网站	2026-03-31
4	华宝基金关于旗下部分基金新增上海证达通基金销售有限公司为代销机构的通知	基金管理人网站	2026-04-15
5	华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2026-04-22
6	华宝基金关于旗下部分基金新增中国邮政储蓄银行股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2026-06-04
7	华宝基金关于旗下部分基金新增北京加和基金销售有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2026-06-05
8	华宝基金关于旗下部分基金新增上海国信嘉利基金销售有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2026-06-10
9	华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加汉口银行申购及定投申购费率优惠活动的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2026-06-30

§ 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

本基金本报告期内无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

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；
华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同；
华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金招募说明书；
华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金托管协议；
基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；
基金托管人业务资格批件和营业执照。

12.2 存放地点

以上文件存于基金管理人办公场所及托管人住所以备投资者查阅。

12.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝基金管理有限公司

2026 年 8 月 31 日