

华夏精选基金

华夏精选固定收益配置基金

未经审计的半年度报告

自2026年1月1日至2026年6月30日



华夏基金
ChinaAMC

未经审计的半年度报告

华夏精选固定收益配置基金

（依据香港法律以伞形基金形式成立的开放式单位信托，
同属华夏精选基金的子基金）

自2026年1月1日至2026年6月30日

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

目录

	页码
管理及行政	1
基金管理人向基金份额持有人的报告	2
未审计的财务报表	
损益及其他全面收益表	3
财务状况表	4 - 5
基金份额持有人应占资产净值变动表	6 - 7
现金流量表	8
投资表现报表 (未审计)	9 – 12
投资组合变动表 (未审计)	13
金融衍生工具的详情 (未审计)	14
投资组合列表 (未审计)	15 – 41
派息披露 (未审计)	42 – 43

重要提示:

本报告内所载的任何意见仅反映基金管理人的意见, 可能发生变更。有关本基金的更多资料, 请参阅刊载于我们网站的基金说明书:

<https://www.chinaamc.com.hk/product/chinaamc-select-fixed-income-allocation-fund/>

投资者制定投资决策时不得依赖本报告所载的资料。

华夏精选固定收益配置基金

（华夏精选基金的子基金）

管理及行政

基金管理人

华夏基金（香港）有限公司
香港中环花园道1号
中银大厦37楼

基金管理人董事

甘添
李丰名
李一梅
孙立强
阳琨

基金管理人的法律顾问

的近律师事务所
香港中环遮打道18号
历山大厦5楼

中国大陆保管人

中国银行股份有限公司
中国北京内
复兴门内大街1号

受托人、行政管理人及基金登记机构

中银国际英国保诚信托有限公司
香港太古城英皇道1111号
15楼1501-1057 & 1513-1516室

审计师

安永会计师事务所
香港鲗鱼涌英皇道979号
太古坊一座27楼

保管人

中国银行（香港）有限公司
香港中环花园道1号
中银大厦14楼

华夏精选固定收益配置基金

（华夏精选基金的子基金）

基金管理人向基金份额持有人的报告

2026年上半年，美伊地缘政治紧张局势推高了全球能源价格，并扭转了市场利率预期。市场最初预期各央行将广泛降息，但第二季度的能源通胀重新引发了加息担忧。美国、德国、英国和澳大利亚的债券收益率上升，收益率曲线呈熊市趋平态势，而由于基本面、通胀和财政供应的差异，跨市场分化显现。

美国经济在上半年表现强劲，劳工市场与通胀数据持续超出市场共识。早前计入的降息预期已被完全逆转，市场开始预期美联储将在年底前加息。美联储已不再提供明确的前瞻性指引，使得后续政策制定机构的言论和经济数据成为政策方向的关键信号。展望未来，预计2年期和10年期美国国债收益率将呈区间交投，而由于大量的债券供应，我们对30年期板块维持谨慎立场。

在欧洲，输入型通胀迫使欧洲央行将政策利率上调25个基点，政策制定机构仍保留进一步加息的选项。尽管如此，德国长期的经济停滞将限制紧缩空间，我们预计终端政策利率将落在2.5%至2.75%的区间内。展望未来，我们预计10年期德国国债收益率将在2.65%至3%的区间内波动，同时将关注美德国债息差扩大带来的相对价值机会。

对于澳大利亚，通胀似乎已见顶且劳工数据走弱，使得澳洲央行的加息周期接近尾声。外部紧缩带来了轻微的上行压力，但澳洲国债收益率有望呈下行趋势，提供优越的跨市场相对价值。投资者可专注于建立10年期中长期债券的仓位，同时保留波段交易的灵活性。

英国金边债券收益率曲线在上半年经历了更大的波动，对通胀的担忧推高了利率，并将10年期收益率推升至5.17%的峰值。然而国内需求依然疲软，核心通胀正走在明显的降温路径上。在短期内，预计10年期金边债券收益率将在4.5%至5%之间交投，若收益率在区间内上行，我们可考虑拉长久期。

总体而言，全球债券市场在短期内不太可能出现持续的牛市行情。美国、德国和英国的利率在短期内将维持高企，但随着通胀降温及经济增长动能减弱，中期内存在下行空间。澳大利亚债券在区间波段交易和跨市场相对价值策略方面均提供最佳的配置价值。我们将持续关注中东地缘政治动态、核心通胀与劳工市场数据，以及央行的政策信号。

华夏基金（香港）有限公司

2026年8月31日

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

损益及其他全面收益表 (未审计)

自2026年1月1日至2026年6月30日

	自2026年1月1日 至2026年6月30日 (未审计) 美元	自2025年1月1日 至2025年6月30日 (未审计) 美元
收入		
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产		
产生的利息收入	35,231,014	32,757,890
银行存款利息收入	42,775	49,703
杂项收入	2,639	17,648
	<u>35,276,428</u>	<u>32,825,241</u>
费用		
管理费	(6,359,542)	(6,196,254)
受托人费用	(865,526)	(872,151)
保管费和银行费用	(263,905)	(262,784)
审计师薪酬	(7,606)	(7,256)
交易手续费	(10,840)	(20,340)
交易成本	(10,275)	-
法律和专业服务费	(1,102)	(5,064)
其他费用	(29,224)	(60,701)
	<u>(7,548,020)</u>	<u>(7,424,550)</u>
减：管理费返还	805,766	314,692
	<u>(6,742,254)</u>	<u>(7,109,858)</u>
融资成本		
对份额持有人的分配		
- I类 (美元派息)	(1,287,357)	-
- A类 (美元派息)	(8,845)	-
- A类 (港币派息)	(12,795)	-
- A类 (人民币派息)	(43)	-
- A类 (人民币派息) — 对冲	(43)	-
	<u>(1,309,083)</u>	<u>-</u>
投资及汇兑差额前利润	27,225,091	25,715,383
投资利得及汇兑差额		
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产		
及负债产生的净利得	14,243,965	25,993,946
汇兑差额	<u>(7,464,279)</u>	<u>238,873</u>
投资利得及汇兑差额净额	6,779,686	26,232,819
税前利润	34,004,777	51,948,202
预扣税	-	(12,554)
基金份额持有人应占资产净值增加	34,004,777	51,935,648

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

财务状况表 (未审计)

2026年6月30日

	2026年6月30日 (未审计) 美元	2025年12月31日 (已审计) 美元
资产		
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	1,731,559,306	1,818,734,630
应收利息	19,083,751	20,212,752
应收认购款	36,884,406	53,039,281
应收基金管理人的款项	234,382	233,642
应收经纪人的款项	67,826,078	2,025,467
定期存款	-	10,563
现金及现金等价物	3,445,996	45,174,495
总资产	1,859,033,919	1,939,430,830
负债		
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	3,795,625	459,973
应付管理费	3,140,646	3,330,413
应付受托人费用	139,731	168,755
应计费用和其他应付款	35,155	23,861
应付赎回款项	1,583,117	66,106,376
应付经纪人的款项	77,371,790	-
总负债 (不含基金份额持有人应占资产净值)	86,066,064	70,089,378
基金份额持有人应占资产净值	1,772,967,855	1,869,341,452
总负债	1,859,033,919	1,939,430,830

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

财务状况表（未审计）（续）

2026年6月30日

	2026年6月30日 (未审计)	2025年12月31日 (已审计)
已发行基金份额数目		
- A类(美元)	1,673,880.26	2,004,452.96
- A类(美元派息)	399,818.13	1,992.89
- A类(人民币)	1,722,174.93	3,508,840.63
- A类(人民币派息)	1,998.15	2,003.14
- A类(人民币派息) — 对冲	1,998.15	1,998.15
- A类(港币)	16,355,701.25	15,814,731.33
- A类(港币派息)	966,427.02	1,994.42
- C类(美元)	12,229,345.03	7,376,090.17
- C类(人民币)	6,817.84	-
- C类(人民币) — 对冲	6,807.87	-
- I类(美元)	19,107,939.33	18,752,106.09
- I类(美元派息)	3,450,905.57	5,004,258.96
- I类(人民币)	-	3,061,388.51
- I类(港币)	3,371,686.54	3,127,372.94
- R类(美元)	22,446,537.32	32,524,349.03
- R类(人民币)	2,427,074,289.05	5,054,855,068.12
- R类(人民币) — 对冲	<u>5,414,551,644.36</u>	<u>3,333,813,790.38</u>
	<u>7,923,367,970.80</u>	<u>8,479,850,437.72</u>
每份额资产净值		
- A类(美元)	12.3086美元	12.1544美元
- A类(美元派息)	10.2630美元	10.3914美元
- A类(人民币)	人民币12.0254元	人民币12.2112元
- A类(人民币派息)	人民币9.6779元	人民币9.9763元
- A类(人民币派息) — 对冲	人民币9.6778元	人民币9.9762元
- A类(港币)	12.3379港币	12.0928港币
- A类(港币派息)	10.3308港币	10.3825港币
- C类(美元)	10.8065美元	10.6390美元
- C类(人民币)	人民币10.0584元	-
- C类(人民币) — 对冲	人民币10.0585元	-
- I类(美元)	13.2079美元	13.0157美元
- I类(美元派息)	12.0858美元	12.2129美元
- I类(人民币)	-	人民币10.2367元
- I类(港币)	12.3831港币	12.1133港币
- R类(美元)	1.0075美元	0.9948美元
- R类(人民币)	人民币1.2136元	人民币1.2322元
- R类(人民币) — 对冲	人民币1.0412元	人民币1.0406元

注：本未经审计的半年度报告是根据国际会计准则委员会颁布的《国际财务报告准则》（“IFRS”）以及香港证券及期货事务监察委员会（“SFC”）制定的《单位信托及互惠基金守则》附录E所列明之相关披露规定编制。

本未经审计的半年度报告采用与截至2025年12月31日止年度的年度报告一致的会计政策，相关政策已载于该年度报告财务报表附注2中。

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

基金份额持有人应占资产净值变动表 (未审计)

自2026年1月1日至2026年6月30日

	基金份额数目	美元
2025年1月1日	1,588,052,781.03	535,335,578
认购的基金份额		
- A类 (美元)	665,784.58	7,768,081
- A类 (美元派息)	1,992.89	20,000
- A类 (人民币)	3,049,819.52	5,065,089
- A类 (人民币派息)	1,998.15	2,743
- A类 (人民币) 一对冲	1,998.15	2,743
- A类 (港币)	4,980,357.20	7,457,493
- A类 (港币派息)	1,994.42	2,570
- C类 (美元)	10,943,705.53	109,500,000
- I类 (美元)	28,162,864.28	345,238,432
- I类 (美元派息)	515,978.12	6,000,000
- I类 (人民币)	8,037,479.06	11,201,714
- R类 (美元)	11,874,323.32	11,186,800
- R类 (人民币)	7,414,279,616.26	1,239,841,434
- R类 (人民币) 一对冲	2,068,547,671.03	288,296,581
	<u>9,551,065,582.51</u>	<u>2,031,583,680</u>
赎回的基金份额		
- A类 (美元)	(418,645.51)	(4,856,241)
- A类 (人民币)	(3,416,992.88)	(5,700,650)
- A类 (港币)	(2,369,258.77)	(3,517,580)
- C类 (美元)	(2,095,925.88)	(21,084,743)
- C类 (人民币)	(1,000.00)	(1,376)
- C类 (人民币) 一对冲	(1,000.00)	(1,376)
- I类 (美元)	(25,770,125.04)	(316,773,399)
- I类 (美元派息)	(516,022.50)	(6,000,000)
- I类 (人民币)	(4,976,090.55)	(6,951,655)
- R类 (人民币)	(1,893,104,244.00)	(319,414,351)
- R类 (人民币) 一对冲	(594,570,226.13)	(82,090,521)
	<u>(2,527,239,531.26)</u>	<u>(766,391,892)</u>
基金份额持有人应占资产净值增加	-	51,935,648
2025年6月30日	<u>8,611,878,832.28</u>	<u>1,852,463,014</u>

华夏精选固定收益配置基金

(华夏精选基金的子基金)

基金份额持有人应占资产净值变动表 (未审计) (续)

自2026年1月1日至2026年6月30日

	基金份额数目	美元
2026年1月1日	8,479,850,437.72	1,869,341,452
认购的基金份额		
- A类 (美元)	610,337.05	7,460,958
- A类 (美元派息)	397,825.24	4,082,329
- A类 (人民币)	24,538.42	43,061
- A类 (港币)	20,989,004.73	32,786,755
- A类 (港币派息)	964,432.60	1,276,888
- C类 (美元)	6,548,049.75	70,000,000
- C类 (人民币)	6,817.84	10,036
- C类 (人民币) 一对冲	6,807.87	10,022
- I类 (美元)	733,780.77	9,601,994
- I类 (美元派息)	20,760.94	252,000
- I类 (港币)	244,313.60	383,145
- R类 (美元)	5,032,206.12	5,000,000
- R类 (人民币)	768,312,294.96	136,708,327
- R类 (人民币) 一对冲	2,918,843,550.92	439,974,266
	<u>3,722,734,720.81</u>	<u>707,589,781</u>
赎回的基金份额		
- A类 (美元)	(940,909.75)	(11,489,414)
- A类 (人民币)	(1,811,204.12)	(3,179,515)
- A类 (人民币派息)	(4.99)	(7)
- A类 (港币)	(20,448,034.81)	(31,912,943)
- C类 (美元)	(1,694,794.89)	(18,017,026)
- I类 (美元)	(377,947.53)	(4,926,935)
- I类 (美元派息)	(1,574,114.33)	(19,140,758)
- I类 (人民币)	(3,061,388.51)	(4,506,025)
- R类 (美元)	(15,110,017.83)	(15,182,032)
- R类 (人民币)	(3,396,093,074.03)	(601,785,617)
- R类 (人民币) 一对冲	(838,105,696.94)	(127,827,883)
	<u>(4,279,217,187.73)</u>	<u>(837,968,155)</u>
基金份额持有人应占资产净值增加	-	34,004,777
2026年6月30日	<u>7,923,367,970.80</u>	<u>1,772,967,855</u>

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

现金流量表 (未审计)

自2026年1月1日至2026年6月30日

	自2026年1月1日 至2026年6月30日 (未审计) 美元	自2025年1月1日 至2025年6月30日 (未审计) 美元
经营活动产生的现金流量		
税前利润	34,004,777	51,948,202
以公允价值计量且其变动计入当期损益的 金融资产减少/(增加)	87,175,324	(1,291,378,895)
定期存款减少/(增加)	10,563	(10,563)
应收利息减少	1,129,001	2,490,824
应收基金管理人的款项(增加)/减少	(740)	1
应收经纪人的款项增加	(65,800,611)	-
以公允价值计量且其变动计入当期损益的 金融负债增加/(减少)	3,335,652	(2,681,391)
应付管理费(减少)/增加	(189,767)	2,542,529
应付受托人费用(减少)/增加	(29,024)	102,691
应计费用和其他应付款 增加/(减少)	11,294	(4,573)
应付经纪人的款项增加/(减少)	77,371,790	(4,688)
经营活动产生/(使用)的现金	137,018,259	(1,236,995,863)
已缴税款	-	(12,927)
经营活动产生/(使用)的现金流量净额	137,018,259	(1,237,008,790)
筹资活动产生的现金流量		
发行基金份额的收益	723,744,656	2,023,484,488
赎回基金份额支付的款项	(902,491,414)	(766,143,803)
筹资活动(使用)/产生的现金流量净额	(178,746,758)	1,257,340,685
现金及现金等价物(减少)/增加净额	(41,728,499)	20,331,895
期初现金及现金等价物	45,174,495	21,097,829
期末现金及现金等价物	3,445,996	41,429,724
现金及现金等价物分析		
银行存款	3,445,996	41,429,724
经营活动产生的现金流量净额包括:		
银行存款利息收入	42,775	49,703

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资表现报表 (未审计)

基金份额持有人应占资产净值
(根据国际财务报告准则计算)

	每份额资产净值	基金份额持有人 应占资产净值
截至2026年6月30日 (未审计)		
- A类 (美元)	12.3086美元	20,603,150美元
- A类 (美元派息)	10.2630美元	4,103,328美元
- A类 (人民币)	人民币12.0254元	3,049,910美元
- A类 (人民币派息)	人民币9.6779元	2,848美元
- A类 (人民币派息) —对冲	人民币9.6778元	2,848美元
- A类 (港币)	12.3379港币	25,735,883美元
- A类 (港币派息)	10.3308港币	1,273,304美元
- C类 (美元)	10.8065美元	132,156,698美元
- C类 (人民币)	人民币10.0584元	10,099美元
- C类 (人民币) —对冲	人民币10.0585元	10,084美元
- I类 (美元)	13.2079美元	252,375,727美元
- I类 (美元派息)	12.0858美元	41,706,921美元
- I类 (港币)	12.3831港币	5,324,834美元
- R类 (美元)	1.0075美元	22,613,764美元
- R类 (人民币)	人民币1.2136元	433,782,760美元
- R类 (人民币) —对冲	人民币1.0412元	830,215,697美元
截至2025年6月30日 (已审计)		
- A类 (美元)	12.1544美元	24,362,915美元
- A类 (美元派息)	10.3914美元	20,709美元
- A类 (人民币)	人民币12.2112元	6,136,171美元
- A类 (人民币派息)	人民币9.9763元	2,862美元
- A类 (人民币派息) —对冲	人民币9.9762元	2,855美元
- A类 (港币)	12.0928港币	24,572,851美元
- A类 (港币派息)	10.3825港币	2,661美元
- C类 (美元)	10.6390美元	78,474,570美元
- I类 (美元)	13.0157美元	244,072,569美元
- I类 (美元派息)	12.2129美元	61,116,488美元
- I类 (人民币)	人民币10.2367元	4,488,043美元
- I类 (港币)	12.1133港币	4,867,531美元
- R类 (美元)	0.9948美元	32,356,002美元
- R类 (人民币)	人民币1.2322元	892,034,407美元
- R类 (人民币) —对冲	人民币1.0406元	496,830,818美元

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资表现报表(未审计) (续)

基金份额持有人应占资产净值(续)
(根据国际财务报告准则计算)

	每份额资产净值	基金份额持有人 应占资产净值
截至2024年12月31日(已审计)		
- A类(美元)	11.5057美元	13,920,187美元
- A类(人民币)	人民币12.1474元	8,533,777美元
- A类(港币)	11.4224港币	6,817,227美元
- C类(美元)	10.0080美元	10,008美元
- C类(人民币)	人民币10.0534元	1,370美元
- C类(人民币)——对冲	人民币10.0534元	1,370美元
- I类(美元)	12.2671美元	199,108,109美元
- I类(美元派息)	11.6588美元	58,344,155美元
- I类(港币)	11.3961港币	3,182,005美元
- R类(美元)	0.9417美元	9,958,116美元
- R类(人民币)	人民币1.2252元	134,800,964美元
- R类(人民币)——对冲	人民币1.0039元	100,658,290美元
截至2023年12月31日(已审计)*		
- A类(美元)	10.9689美元	5,378,770美元
- A类(人民币)	人民币11.2375元	374,111美元
- A类(港币)	10.9512港币	6,418,663美元
- I类(美元)	11.6583美元	37,198,207美元
- I类(美元派息)	11.0809美元	8,237,377美元
- I类(港币)	10.8935港币	3,024,360美元
- R类(人民币)	人民币1.1335元	7,851,173美元
- R类(人民币)——对冲	人民币0.9901元	43,704,144美元

* 2023年12月31日不是工作日,所有公布的每份额资产净值数据均为2023年12月29日数据。

华夏精选固定收益配置基金

（华夏精选基金的子基金）

投资表现报表（未审计）（续）

每份额的最高发行价格和最低赎回价格¹

	每份额的 最高发行 价格	每份额的 最低赎回 价格
自 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日（未审计）		
- A 类（美元）	12.3104美元	12.1119美元
- A 类（美元派息）	10.4125美元	10.2225美元
- A 类（人民币）	人民币12.2327元	人民币11.9407元
- A 类（人民币派息）	人民币9.9939元	人民币9.6185元
- A 类（人民币）—对冲	人民币9.9938元	人民币9.6184元
- A类（港币）	12.3414港币	12.1036港币
- A 类（港币派息）	10.4528港币	10.2778港币
- C 类（美元）	10.8079美元	10.6172美元
- C 类（人民币）	人民币10.0819元	人民币9.9835元
- C 类（人民币）—对冲	人民币10.0820元	人民币9.9836元
- I 类（美元）	13.2097美元	12.9832美元
- I 类（美元派息）	12.2434美元	12.0300美元
- I 类（人民币）	人民币10.2554元	人民币10.1996元
- I 类（港币）	12.3865港币	12.1246港币
- R 类（美元）	1.0076美元	0.9913美元
- R 类（人民币）	人民币1.2344元	人民币1.2051元
- R 类（人民币）—对冲	人民币1.0477元	人民币1.0315元
截至2025年12月31日止年度（已审计）		
- A 类（美元）	12.1580美元	11.4728美元
- A 类（美元派息）	10.4650美元	9.9920美元
- A 类（人民币）	人民币12.4170元	人民币12.0067元
- A 类（人民币派息）	人民币10.2203元	人民币9.9285元
- A 类（人民币）—对冲	人民币10.2202元	人民币9.9285元
- A类（港币）	12.0968港币	11.4183港币
- A 类（港币派息）	10.4414港币	9.9520港币
- C 类（美元）	10.6420美元	9.9829美元
- C 类（人民币）	人民币10.0919元	人民币9.9398元
- C 类（人民币）—对冲	人民币10.0919元	人民币9.9398元
- I 类（港币）	12.1171港币	11.3937港币
- I 类（美元）	13.0194美元	12.2342美元
- I 类（美元派息）	12.2891美元	11.6274美元
- I 类（人民币）	人民币10.4004元	人民币10.0000元
- R 类（美元）	0.9951美元	0.9390美元
- R 类（人民币）	人民币1.2529元	人民币1.2111元
- R 类（人民币）—对冲	人民币1.0422元	人民币1.0016元
截至2024年12月31日止年度（已审计）		
- I 类（港币）	11.5037港币	10.8762港币
- I 类（美元）	12.3556美元	11.6435美元
- I类（美元派息）	11.7434美元	11.0699美元
- A 类（美元）	11.5992美元	10.9544美元
- A 类（港币）	11.5400港币	10.9329港币
- A 类（人民币）	人民币 12.1474元	人民币11.2678元
- R 类（美元）	0.9458美元	0.9393美元
- R 类（人民币）	人民币1.2252元	人民币1.1366元
- R 类（人民币）—对冲	人民币1.0241元	人民币0.9870元
- C类（美元）	10.0080美元	9.9981美元
- C 类（人民币）	人民币10.0534元	人民币9.9904元
- C 类（人民币）—对冲	人民币10.0534元	人民币9.9904元

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资表现报表(未审计) (续)

每份额的最高发行价格和最低赎回价格¹

	每份额的 最高发行 价格	每份额的 最低赎回 价格
截至2023年12月31日止年度(已审计)		
-I类(港币)	10.8972港币	10.1823港币
-I类(美元)	11.6591美元	10.8917美元
-I类(美元派息)	11.0817美元	10.7616美元
-A类(美元)	10.9699美元	10.2658美元
-A类(港币)	10.9553港币	10.2527港币
-A类(人民币)	人民币11.3486元	人民币10.0240元
-R类(人民币)	人民币1.1447元	人民币1.0184元
-R类(人民币)—对冲	人民币0.9907元	人民币0.9529元
截至2022年12月31日止年度(已审计)		
-I类(港币)	10.6607港币	10.0145港币
-I类(美元)	11.4286美元	10.6637美元
-A类(美元)	10.7852美元	10.0508美元
-A类(港币)	10.7502港币	10.0856港币
-A类(人民币)	人民币10.7177元	人民币9.5746元
-R类(人民币)—对冲	人民币0.9944元	人民币0.9363元
截至2021年12月31日止年度(已审计)		
-I类(港币)	10.8334港币	10.4553港币
-I类(美元)	11.6339美元	11.2183美元
-I类(美元派息)	10.7771美元	10.7616美元
-A类(美元)	10.9927美元	10.5932美元
-A类(港币)	10.9395港币	10.5495港币
-A类(人民币)	人民币10.2688元	人民币9.7483元
-R类(美元)	1.0048美元	0.9683美元
-R类(人民币)—对冲	人民币1.0000元	人民币0.9721元
截至2020年12月31日止年度(已审计)		
-I类(港币)	10.6071港币	10.5553港币
-I类(美元)	11.4111美元	10.3474美元
-I类(美元派息)	10.7733美元	9.7690美元
-A类(美元)	10.8126美元	9.8351美元
-A类(港币)	10.7171港币	9.7517港币
截至2019年12月31日止年度(已审计)		
-I类(港币)	10.6213港币	10.0892港币
-I类(美元)	10.6506美元	10.1111美元
-I类(美元派息)	10.0953美元	10.0000美元
-A类(美元)	10.1357美元	9.9875美元
-A类(港币)	10.1447港币	10.0000港币
自2018年8月28日(成立日期)至2018年12月31日		
-I类(港币)	10.0840港币	9.9521港币
-I类(美元)	10.1075美元	9.9533美元

¹所示本子基金的过往业绩并不预示其未来业绩。

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未审计)

自2026年1月1日至2026年6月30日

在净资产中的占比
2026年6月30日

上市债券	51.81%
未上市债券	22.62%
未上市基金	23.21%
其他净资产	2.36%
净资产总额	100.00%

华夏精选固定收益配置基金

（华夏精选基金的子基金）

金融衍生工具的详情（未审计）

于2026年6月30日，本子基金持有的金融衍生工具详情如下：

远期外汇合约

待交割的合约金额	汇兑金额	结算日期	交易对手	公允价值 美元
<u>金融资产</u>				
690美元	1,000澳元	26/08/2026	花旗银行香港分行	1
415,475美元	599,000澳元	26/08/2026	摩根大通银行	3,207
1,893,823美元	人民币12,800,000元	15/07/2026	摩根大通银行	6,827
495,804美元	706,000澳元	13/07/2026	花旗银行香港分行	9,491
423,466美元	597,000澳元	26/10/2026	摩根大通银行	12,987
人民币50,000,000元	7,397,872美元	30/09/2026	中国银行（香港）有限公司	15,759
1,186,576美元	1,690,000澳元	13/07/2026	摩根大通银行	22,456
13,440,316美元	人民币91,000,000元	15/07/2026	中国银行（香港）有限公司	24,953
1,501,094美元	2,120,000澳元	13/07/2026	中国银行（香港）有限公司	40,777
2,036,513美元	2,892,000澳元	26/08/2026	摩根大通银行	46,067
1,348,558美元	1,890,000澳元	26/10/2026	花旗银行香港分行	49,053
2,040,255美元	2,891,000澳元	26/08/2026	摩根大通银行	50,497
1,776,561美元	1,500,000欧元	26/10/2026	摩根大通银行	57,201
4,055,040美元	5,797,000澳元	26/08/2026	摩根大通银行	65,200
2,154,164美元	1,825,000欧元	13/07/2026	摩根大通银行	72,082
63,465,169美元	人民币430,000,000元	15/07/2026	摩根大通银行	73,892
2,166,478美元	3,000,000澳元	14/07/2026	摩根大通银行	100,035
4,114,569美元	5,745,000澳元	26/08/2026	摩根大通银行	160,518
				<u>811,003</u>
<u>金融负债</u>				
831,690,695美元	人民币5,584,553,512元	30/09/2026	中国银行（香港）有限公司	(3,653,489)
1,342,180美元	1,890,000澳元	26/10/2026	摩根大通银行	(42,675)
人民币200,000,000元	29,425,742美元	02/07/2026	摩根大通银行	(32,109)
5,922,168美元	人民币40,000,000元	15/07/2026	摩根大通银行	(25,312)
10,334,463美元	人民币70,000,000元	15/07/2026	摩根大通银行	(14,964)
572,585美元	490,800欧元	26/08/2026	摩根大通银行	(11,586)
705,571美元	612,000欧元	15/07/2026	摩根大通银行	(7,302)
1,094,934美元	人民币7,400,000元	15/07/2026	摩根大通银行	(4,015)
739,528美元	人民币5,000,000元	15/07/2026	摩根大通银行	(2,421)
443,363美元	人民币3,000,000元	15/07/2026	摩根大通银行	(1,098)
295,497美元	人民币2,000,000元	15/07/2026	摩根大通银行	(654)
				<u>(3,795,625)</u>

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合列表 (未审计)

2026年6月30日

上市/挂牌投资	名义数量	公允价值 美元	在资产净值 中的占比
<u>债务证券</u>			
<u>澳大利亚</u>			
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK GROUP LTD 5.731% S/A 18SEP2034	1,200,000	1,223,076	0.07%
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD 2.57% S/A 25NOV2035 REGS	2,000,000	1,795,040	0.10%
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 4.25% S/A 21MAR2036	18,000,000	11,949,291	0.67%
AUSTRALIAN METCOAL FINANCING PTY LTD 6.25% S/A 22OCT2031	200,000	203,838	0.01%
AUSTRALIAN METCOAL FINANCING PTY LTD 6.75% S/A 22APR2034	200,000	206,984	0.01%
CIMIC FINANCE LTD 6% S/A 22APR2036 REGS	1,200,000	1,189,356	0.07%
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA/NEW YORK 4.423% S/A 14MAR2028	500,000	500,850	0.03%
MACQUARIE BK 5.819% S/A 10JUN2037 REGS	800,000	803,624	0.05%
NBN CO LTD 4.15% S/A 16SEP2030 REGS	1,500,000	1,476,690	0.08%
QBE INSURANCE GROUP LTD 5.239% S/A 10NOV2037	2,600,000	2,578,862	0.15%
SANTOS FINANCE LTD 4.125% S/A 14SEP2027	2,000,000	1,983,580	0.11%
SANTOS FINANCE LTD 5.25% S/A 13MAR2029	1,000,000	1,007,180	0.06%
SYDNEY AIRPORT FINANCE CO PTY LTD 5.248% S/A 26MAR2036	1,100,000	1,093,983	0.06%
WESTPAC BANKING CORP/NEW ZEALAND 5% S/A PERP	4,750,000	4,747,102	0.27%
		30,759,456	1.74%
<u>百慕大群岛</u>			
RLGH FINANCE BERMUDA LTD 6.75% S/A 02JUL2035	2,500,000	2,594,925	0.15%
RLGH FINANCE BERMUDA LTD 6.875% S/A PERP	5,000,000	5,014,200	0.28%
RLGH FINANCE BERMUDA LTD 8.25% S/A 17JUL2031	1,800,000	1,991,502	0.11%
		9,600,627	0.54%
<u>加拿大</u>			
BANK OF MONTREAL 4.8% S/A PERP	1,000,000	1,000,050	0.06%
BK OF NOVA SCOTIA 3.625% Q 27OCT2081	13,100,000	12,934,940	0.73%
ENBRIDGE INC 4.9% S/A 20 JUN 2030	200,000	200,626	0.01%
ENBRIDGE INC 5.55% S/A 20 JUN 2035	300,000	305,208	0.02%
ENBRIDGE INC 5.95% S/A 05APR2054	500,000	501,155	0.03%
ENBRIDGE INC 6% S/A 15NOV2028	2,000,000	2,061,020	0.12%
TORONTO-DOMINION BANK 5.146% S/A 10SEP2034	1,000,000	1,001,900	0.06%
TORONTO-DOMINION BANK 8.125% Q 31OCT2082	9,639,000	9,990,824	0.56%
		27,995,723	1.59%

华夏精选固定收益配置基金

（华夏精选基金的子基金）

投资组合列表（未审计）（续）

2026年6月30日

上市/挂牌投资	名义数量	公允价值 美元	在资产净值 中的占比
<u>债务证券（续）</u>			
开曼群岛			
AAC TECHNOLOGIES HLDGS INC 3.75% S/A 02JUN2031	2,500,000	2,348,375	0.13%
ABQ FINANCE LTD 2% S/A 25MAR2030	2,700,000	2,707,128	0.15%
AL RAJHI TIER 1 SUKUK LTD 6.15% S/A PERPETUAL	1,000,000	1,005,100	0.06%
BSF FINANCE 5.761% 03SEP2035	1,600,000	1,574,528	0.09%
CDBL FUNDING 1 4.75% S/A 27MAY2030	1,000,000	1,003,030	0.06%
CHAMPION MTN LTD 2.95% S/A 15JUN2030	1,000,000	889,770	0.05%
CHINA HONGQIAO GROUP LTD 6.925% S/A 29NOV2028	1,000,000	1,033,170	0.06%
CHINA HONGQIAO GROUP LTD 7.05% S/A 10JAN2028	2,400,000	2,456,280	0.14%
CHINA MENGNIU DAIRY CO LTD 2.3% S/A 30JUL2035	1,600,000	230,326	0.01%
CHINA MODERN DAIRY HLDGS LTD 2.125% S/A 14JUL2026	7,200,000	7,193,016	0.41%
CHINA MODERN DAIRY HLDGS LTD 4.875% S/A 10JUL2030	1,500,000	1,476,285	0.08%
CHINA RESOURCES LAND LTD 4.125% S/A 20NOV2028	4,600,000	4,529,666	0.26%
CK HUTCHISON INTL 25 LTD 4.25% S/A 26SEP2030	2,000,000	1,974,580	0.11%
ENN ENERGY HLDGS LTD 4.625% S/A 17MAY2027 REGS	1,847,000	1,842,789	0.10%
FWD GROUP HOLDINGS LTD 5.836% S/A 22SEP2035	2,000,000	1,998,040	0.11%
FWD GROUP LTD 5.252% S/A 22SEP2030	4,000,000	3,981,080	0.22%
FWD GROUP LTD 7.635% S/A 02JUL2031	2,500,000	2,722,775	0.15%
GACI FIRST INVESTMENT CO 4.875% S/A 14MAY2029	1,600,000	1,593,872	0.09%
HPHT FINANCE 21 II LTD 1.5% S/A 17SEP2026	3,875,000	3,849,115	0.22%
JD.COM INC 2.75% S/A 10APR2036	7,400,000	1,108,578	0.06%
JD.COM INC 3.375% S/A 14JAN2030	1,000,000	965,090	0.05%
KUAISHOU TECHNOLOGY 4.125% S/A 22JAN2031	1,000,000	982,040	0.06%
KUAISHOU TECHNOLOGY 2.45% S/A 22JAN2031	10,000,000	1,495,678	0.08%
MEITUAN 3.1% S/A 05NOV2035	7,800,000	1,144,574	0.06%
MEITUAN 4.5% S/A 2APR2028 REGS	4,400,000	4,375,668	0.25%
MEITUAN DIANPING 3.05% S/A 28OCT2030 REGS	2,800,000	2,588,768	0.15%
MEITUAN DIANPING 4.625% S/A 02OCT2029 REGS	4,000,000	3,957,040	0.22%
MEITUAN DIANPING 4.75% S/A 05NOV2032 REGS	400,000	387,452	0.02%
MELCO RESORTS FINANCE LTD 5.375% S/A 04DEC2029 REGS	1,000,000	975,020	0.05%
MGM CHINA HLDGS LTD 6.25% S/A 15MAY2033	500,000	490,910	0.03%
MGM CHINA HLDGS LTD 7.125% S/A 01FEB2027 REGS	250,000	258,687	0.01%
PHOENIX GROUP HLDGS 5.375% S/A 06JUL2027	4,000,000	4,009,720	0.23%
RIYAD BANK 5.805% S/A 14JAN2036	500,000	492,330	0.03%
SANDS CHINA LTD 2.3% S/A 08MAR2027	7,134,000	7,025,135	0.40%

华夏精选固定收益配置基金

(华夏精选基金的子基金)

投资组合列表 (未审计) (续)

2026年6月30日

上市/挂牌投资	名义数量	公允价值 美元	在资产净值 中的占比
<u>债务投资 (续)</u>			
开曼群岛 (续)			
SANDS CHINA LTD 2.85% S/A 08MAR2029	500,000	473,560	0.03%
SAUDI ELECTRICITY SUKUK PROGRAMME CO 5.225% S/A 18FEB2030	2,000,000	2,020,700	0.11%
SAUDI ELECTRICITY SUKUK PROGRAMME CO 5.489% S/A 18FEB2035 REGS	2,000,000	2,038,340	0.11%
SNB FUNDING LTD 6% S/A 24JUN2035	1,900,000	1,916,359	0.11%
SRC SUKUK LTD 5% S/A 27FEB2028	2,350,000	2,355,311	0.13%
SRC SUKUK LTD 5.375% S/A 27FEB2035	1,100,000	1,116,918	0.06%
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD 5.95% S/A 17JUL2026	10,109,000	10,113,650	0.57%
TENCENT HLDGS LTD 3.595% S/A 19JAN2028 REGS	2,000,000	1,976,200	0.11%
TENCENT HLDGS LTD 5% S/A 16JUN2036	1,800,000	1,798,938	0.10%
TENCENT HLDGS LTD 5.6% S/A 16JUN2046 REGS	600,000	599,388	0.03%
TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP 2% S/A 03SEP2030	2,000,000	1,799,380	0.10%
WEIBO CORP 3.375% S/A 08JUL2030	8,000,000	7,501,760	0.42%
		108,376,119	6.08%
智利			
CCODELCO INC 5.529% S/A 30JAN2037	400,000	394,968	0.02%
CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE 6.33% S/A 13JAN2035 REGS	250,000	263,002	0.01%
INVERSIONES CMPC SA 6.125% S/A 26FEB2034 REGS	700,000	694,939	0.04%
REP OF CHILE 5.65% S/A 13JAN2037	200,000	207,898	0.01%
		1,560,807	0.08%
中国内地			
CHENGDU INLAND PORT HUB 4.9% S/A 20AUG2028 REGS	4,000,000	590,307	0.03%
CHINA GOVERNMENT INTL BOND 2.375% A 25NOV2029	500,000	567,750	0.03%
CHINA GOVERNMENT INTL BOND 2.625% A 25NOV2032	500,000	565,823	0.03%
GANSU PROVINCIAL HIGHWAY AVIATION TOURISM INVESTMENT GROUP CO LTD 3.9% S/A 27SEP2026	2,000,000	296,670	0.02%
GANZHOU TOURISM INVESTMENT GROUP CO LTD 2.85% S/A 19 AUG2028	5,000,000	737,736	0.04%
GANZHOU URBAN INVESTMENT HLDG GROUP CO LTD 3.15% S/A 29JAN2029	5,000,000	741,867	0.04%
GUANGZHOU DEVELOPMENT DISTRICT HLDG GROUP CO LTD 2.85% S/A 19JAN2027	400,000	395,420	0.02%
JIUJIANG MUNICIPAL DEVELOPMENT GROUP CO LTD 2.9% S/A 25JUL2028	2,500,000	369,597	0.02%
JIUJIANG MUNICIPAL DEVELOPMENT GROUP CO LTD 6.55% S/A 8MAY2027	300,000	304,935	0.02%
NANNING COMMUNICATIONS INVESTMENT GROUP CO LTD 7.3% S/A 30APR2027	2,400,000	2,447,448	0.14%

华夏精选固定收益配置基金

（华夏精选基金的子基金）

投资组合列表（未审计）（续）

2026年6月30日

上市/挂牌投资	名义数量	公允价值 美元	在资产净值 中的占比
<u>债务证券（续）</u>			
中国内地（续）			
NANYANG URBAN INVESTMENT HOLDINGS CO LTD 5.4% S/A 29SEP2028	5,000,000	742,994	0.04%
SUZHOU CITY CONSTRUCTION INVESTMENT GROUP (HOLDING) CO LTD 5% S/A 15JUL2028	1,500,000	1,507,080	0.09%
SX FENGXI DEVELOPMENT GR 4.95% S/A 28SEP2026	2,000,000	297,545	0.02%
SZ YINTONG AM INV S/A 4.5% 30JUL2028	2,000,000	301,816	0.02%
WUHAN METRO GROUP CO LTD 4.45% S/A 22OCT2027	1,000,000	998,310	0.06%
WUHAN OPTICAL VALLEY FINANCIAL HOLDING GROUP CO LTD 3.5% S/A 03JUL2028	20,000,000	2,970,001	0.17%
ZHANGZHOU TRANSPORTATION DEVELOPMENT GROUP CO LTD 5.1% 09APR2028	1,700,000	1,713,413	0.10%
ZHENGZHOU REAL ESTATE GROUP CO LTD 2.7% S/A 22JUL2028	10,000,000	1,478,388	0.08%
ZHUZHOU CITY CONSTRUCTION DEVELOPMENT GROUP CO LTD 5.3% S/A 18 MAR 2028	1,000,000	1,006,720	0.06%
		18,033,820	1.03%
爱沙尼亚			
BANCO SANTANDER SA 5.365% S/A 15JUL2028	1,000,000	1,008,380	0.06%
BANCO SANTANDER SA 5.439% S/A 15JUL2031	1,000,000	1,026,150	0.06%
		2,034,530	0.12%
法国			
BNP PARIBAS SA 3.6% A 17AUG2031	100,000,000	14,752,073	0.83%
BNP PARIBAS SA 4.625% S/A PERP REGS	200,000	199,368	0.01%
BNP PARIBAS SA 7.45% S/A PERPETUAL REGS	900,000	929,898	0.05%
BNP PARIBAS SA 8.5% S/A PERP REGS	1,000,000	1,054,260	0.06%
CREDIT AGRICOLE SA 7.125% S/A PERPETUAL	3,750,000	3,866,212	0.22%
L'OREAL SA 5% S/A 20MAY2035 REGS	1,750,000	1,767,850	0.10%
		22,569,661	1.27%
德国			
ALLIANZ SE 3.2% A PERP	10,000,000	9,591,100	0.55%
ALLIANZ SE 6.55% A PERP	4,000,000	4,060,760	0.23%
DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK 5.414% S/A 10MAY2029	500,000	511,375	0.03%
DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK 6.819% S/A 20NOV2029	1,000,000	1,046,050	0.06%
		15,209,285	0.87%
中国香港			
AIA GROUP LTD 2.88% S/A 30APR2036	4,000,000	590,271	0.03%
AIRPORT AUTHORITY HONG KONG 2.85% Q 14JAN2035	3,300,000	510,156	0.03%
AIRPORT AUTHORITY HONG KONG 3.4% S/A 14JAN2055 REGS	2,500,000	404,717	0.02%

华夏精选固定收益配置基金

(华夏精选基金的子基金)

投资组合列表 (未审计) (续)

2026年6月30日

上市/挂牌投资	名义数量	公允价值 美元	在资产净值 中的占比
<u>债务证券 (续)</u>			
中国香港 (续)			
AIRPORT AUTHORITY HONG KONG 4.75% S/A 15JUL2028	3,000,000	3,023,220	0.17%
AIRPORT AUTHORITY HONG KONG 4.875% S/A 15JUL2030 REGS	1,200,000	1,226,784	0.07%
AIRPORT AUTHORITY HONG KONG 5.125% S/A 15JAN 2035 REGS	500,000	523,675	0.03%
BANK OF EAST ASIA LTD 4.875% S/A 22APR2032	8,642,000	8,622,122	0.49%
BANK OF EAST ASIA LTD 5.375% S/A 13MAY2032	2,200,000	2,204,840	0.12%
BANK OF EAST ASIA LTD 6.75% S/A 27JUN2034	10,200,000	10,572,096	0.60%
BLOSSOM JOY LTD 2.2% S/A 21OCT2030	1,000,000	910,400	0.05%
CHINA CITIC BANK INTL LTD 6% S/A 05DEC2033	6,330,000	6,506,734	0.37%
CHINA PING AN INSURANCE OVERSEAS HLDGS LTD 5% S/A 08OCT2035	3,000,000	2,959,560	0.17%
CHINA PING AN INSURANCE OVERSEAS HLDGS LTD 6.125% S/A 16MAY2034	484,000	514,066	0.03%
CHINA TAIPING INSURANCE HLDGS CO LTD 6.4% S/A PERP	1,500,000	1,544,550	0.09%
CHIYU BANKING CORP LTD 5.75% S/A 07APR2032	250,000	250,287	0.01%
CHIYU BANKING CORP LTD 8% S/A PERP	500,000	520,460	0.03%
CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 3.875% S/A 19JUN2029	3,000,000	2,940,840	0.17%
CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 4.125% S/A 19JUL2027	1,100,000	1,095,215	0.06%
CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 5.125% S/A 14MAR2028	3,000,000	3,029,970	0.17%
DAH SING BANK LTD 3% S/A 02NOV2031	4,460,000	4,424,766	0.25%
DAH SING BANK LTD 7.375% S/A 15NOV2033	11,950,000	12,486,197	0.70%
FAR EAST HORIZON LTD 4.25% S/A 14FEB2028	30,000,000	4,490,567	0.25%
FAR EAST HORIZON LTD 4.25% S/A 26OCT2026	13,871,000	13,837,155	0.78%
FAR EAST HORIZON LTD 5.25% S/A 13JAN2029	500,000	495,620	0.03%
FAR EAST HORIZON LTD 5.875% S/A 5MAR2028	7,127,000	7,176,960	0.43%
FAR EAST HORIZON LTD 6% S/A 01OCT2028	5,835,000	5,894,809	0.33%
FAR EAST HORIZON LTD 6.625% S/A 16APR2027	13,349,000	13,506,785	0.79%
HPHT FINANCE LTD 5% S/A 21FEB2030	2,454,000	2,457,951	0.14%
LENOVO GROUP LTD 3.421% S/A 02NOV2030 REGS	500,000	472,590	0.03%
LENOVO GROUP LTD 6.536% S/A 27JUL2032 REGS	1,300,000	1,401,426	0.08%
NANYANG COMMERCIAL BANK LTD 6% S/A 6AUG2034	250,000	255,475	0.01%
NANYANG COMMERCIAL BANK LTD 6.5% S/A PERP	10,000,000	10,141,200	0.57%
SHANGHAI COMMERCIAL BANK LTD 6.375% S/A 28FEB2033	1,000,000	1,014,290	0.06%
SHANGRAO INVESTMENT HLDGS INTL CO LTD 4.4% S/A 30OCT2028	1,000,000	994,890	0.06%
SWIRE PROPERTIES MTN FINANCING LTD 3.4% S/A 03SEP2029	2,000,000	306,749	0.02%

华夏精选固定收益配置基金

(华夏精选基金的子基金)

投资组合列表 (未审计) (续)

2026年6月30日

上市/挂牌投资	名义数量	公允价值 美元	在资产净值 中的占比
<u>债务证券 (续)</u>			
中国香港 (续)			
SWIRE PROPERTIES MTN FINANCING LTD 3.45% S/A 22JUL2035	1,000,000	152,255	0.01%
WELL LINK LIFE INSURANCE 7.875% S/A 23JUN2036	900,000	868,230	0.05%
XIAOMI BEST TIME INTL LTD 2.875% S/A 14JUL2031 REGS	1,000,000	915,370	0.05%
		129,243,248	7.35%
印度			
AXIS BANK LTD 6.875% S/A PERP	670,000	673,484	0.04%
AXIS BANK LTD/GANDHINAGAR 5.348% S/A 30JUN2031	3,300,000	3,324,057	0.19%
AXIS BANK LTD/GIFT CITY 4.1% S/A PERP REGS	2,000,000	1,993,200	0.11%
HDFC BANK LTD 3.7% S/A PERP	1,000,000	995,510	0.06%
MUTHOOT FINANCE LTD 5.75% S/A 04AUG2030 REGS	200,000	195,904	0.01%
MUTHOOT FINANCE LTD 6.375% S/A 02MAR2030 REGS	500,000	499,870	0.03%
MUTHOOT FINANCE LTD 6.375% S/A 23APR2029 REGS	400,000	401,108	0.02%
POWER FINANCE CORP LTD 5.32% S/A 30JUN2031	800,000	805,336	0.05%
REC LTD 4.75% S/A 27SEP2029	1,000,000	991,420	0.06%
TATA CAPITAL LTD 5.389% S/A 21JUL2028	1,500,000	1,508,940	0.09%
		11,388,829	0.66%
印度尼西亚			
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT 5.25% S/A 10APR2031	1,000,000	998,100	0.06%
BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK 7.15% S/A PERP	700,000	699,272	0.04%
INDONESIA GOVERNMENT INTL BOND 2.45% S/A 04MAR2029	2,800,000	412,790	0.02%
INDONESIA GOVERNMENT INTL BOND 2.5% S/A 31OCT2030	7,000,000	1,027,717	0.06%
INDONESIA GOVERNMENT INTL BOND 3.05% S/A 04MAR2036	2,000,000	293,442	0.02%
INDONESIA GOVERNMENT INTL BOND 3.5% S/A 11JAN2028	3,000,000	2,967,630	0.17%
INDONESIA GOVERNMENT INTL BOND 5.25% S/A 15JAN2030	500,000	507,325	0.03%
KRAKATAU POSCO PT 6.375% S/A 11JUN2027	500,000	502,585	0.03%
PERTAMINA HUTU ENERGI PT 5.25% S/A 21MAY2030	1,500,000	1,502,325	0.08%
PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA 4.75% S/A 03FEB2031 REGS	1,500,000	1,468,785	0.08%
PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA 5.45% S/A 03FEB2036 REGS	1,500,000	1,441,800	0.08%
PT SARANA MULTI INFRASTRUKTUR PERUSAHAAN PERSEROAN 5% S/A 13MAY2031	200,000	197,450	0.01%
REPUBLIC OF INDONESIA 5.6% S/A 15JAN2035	1,300,000	1,324,570	0.07%
		13,343,791	0.75%

华夏精选固定收益配置基金

（华夏精选基金的子基金）

投资组合列表（未审计）（续）

2026年6月30日

上市/挂牌投资	名义数量	公允价值 美元	在资产净值 中的占比
<u>债务证券（续）</u>			
爱尔兰			
SANTANDER INTERNATIONAL PRODUCTS PLC 5.7% A 11NOV2034	5,000,000	5,000,000	0.28%
SANTANDER INTERNATIONAL PRODUCTS PLC 5.75% A 12NOV2034	7,000,000	7,000,000	0.39%
		12,000,000	0.67%
日本			
ASAHI MUTUAL LIFE INSURANCE CO 6.9% S/A PERP CHUGOKU ELECTRIC POWER CO INC 5.742% S/A 14JAN2035	800,000 700,000	821,480 721,077	0.05% 0.04%
DAI-ICHI LIFE INSURANCE CO LTD 4% S/A PERP REGS	17,506,000	17,499,348	0.99%
DENSO CORP 4.864% S/A 29JUN2031 REGS	200,000	201,630	0.01%
KANSAI ELECTRIC POWER CO INC 5.037% S/A 26FEB2030	500,000	504,515	0.03%
MARUBENI CORP 5.383% S/A 01APR2035	300,000	306,696	0.02%
mitsubishi HC FINANCE AMERICA LLC 4.558% S/A 14JAN2031 REGS	500,000	492,970	0.03%
mitsubishi UFJ FINANCIAL GROUP INC 5.159% S/A 24APR2031	900,000	911,520	0.05%
mitsubishi UFJ FINANCIAL GROUP INC 5.197% S/A 16JAN2031	1,300,000	1,318,811	0.07%
mitsubishi UFJ FINANCIAL GROUP INC 5.574% S/A 16JAN2036	2,000,000	2,057,140	0.12%
mitsubishi UFJ FINANCIAL GROUP INC 8.2% S/A PERP mitsubishi UFJ FINANCIAL GROUP INC S+1.02% Q 14JAN2032	1,000,000 3,400,000	1,077,020 3,410,336	0.06% 0.19%
mitsubishi UFJ FINANCIAL GROUP INC S+1.13% Q 12SEP2031	5,000,000	5,039,600	0.28%
mitsubishi UFJ FINANCIAL GROUP INC S+1.48% Q 24APR2031	1,600,000	1,632,272	0.09%
MIZUHO BANK LTD 4.395% S/A 16APR2029	3,000,000	2,995,800	0.17%
MIZUHO BANK LTD S+0.8% Q 16APR2029	750,000	754,627	0.04%
MIZUHO BANK LTD S+1.05% Q 16APR2031	2,800,000	2,848,440	0.16%
MIZUHO CORP BANK LTD 4.695% S/A 16APR2031 REGS	500,000	502,650	0.03%
MIZUHO FINANCIAL GROUP INC 5.098% S/A 13MAY2031	500,000	505,525	0.03%
MIZUHO FINANCIAL GROUP INC S+1.08% Q 13JUL2032	400,000	400,392	0.02%
MIZUHO FINANCIAL GROUP INC S+1.08% Q 13MAY2031	1,500,000	1,508,130	0.09%
MIZUHO FINANCIAL GROUP INC S+1.25% Q 08JUL2031	900,000	910,575	0.05%
NIPPON LIFE INSURANCE CO 4% S/A 19SEP2047 REGS	10,000,000	9,908,100	0.56%
NIPPON LIFE INSURANCE CO 4.114% A 23JAN2055	300,000	314,868	0.02%
NOMURA HLDGS INC 1.653% S/A 14JUL2026	300,000	299,685	0.02%
NOMURA HLDGS INC 2.329% S/A 22JAN2027	4,000,000	3,953,120	0.22%
NOMURA HLDGS INC 3.103% S/A 16JAN2030	1,500,000	1,413,615	0.08%
NOMURA HLDGS INC 4.904% S/A 01JUL2030	800,000	800,400	0.05%

华夏精选固定收益配置基金

（华夏精选基金的子基金）

投资组合列表（未审计）（续）

2026年6月30日

上市/挂牌投资	名义数量	公允价值 美元	在资产净值 中的占比
<u>债务证券（续）</u>			
日本（续）			
NOMURA HLDGS INC 5.043% S/A 10JUN2036	4,200,000	4,113,690	0.23%
NOMURA HLDGS INC 5.166% S/A 14JUL2031	2,000,000	2,012,440	0.11%
NOMURA HLDGS INC 5.491% S/A 29JUN2035	400,000	408,264	0.02%
NOMURA HLDGS INC 7% S/A PERPETUAL	3,800,000	3,902,980	0.22%
NOMURA HOLDINGS INC 6.17% S/A 16APR2031	2,400,000	1,684,916	0.10%
NOMURA INTERNATIONAL FUNDING PTE LTD 5.545% S/A 14JUL2036	1,300,000	1,312,051	0.07%
NORINCHUKIN BANK 5.094% S/A 16OCT2029 REGS	200,000	201,554	0.01%
NTT FINANCE CORP 4.091% A 16JUL2037 REGS	250,000	287,276	0.02%
NTT FINANCE CORP 4.567% S/A 16JUL2027 REGS	1,900,000	1,901,311	0.11%
NTT FINANCE CORP 4.876% S/A 16JUL2030 REGS	2,200,000	2,202,728	0.12%
NTT FINANCE CORP 5.171% S/A 16JUL2032 REGS	4,000,000	4,015,000	0.23%
NTT FINANCE CORP 5.502% S/A 16JUL2035 REGS	1,500,000	1,518,030	0.09%
NTT FINANCE CORP S+1.08% Q 16JUL2028 REGS	2,900,000	2,921,257	0.16%
NTT FINANCE CORP S+1.31% Q 16JUL2030 REGS	3,500,000	3,562,755	0.20%
OLYMPUS CORP 2.143% S/A 08DEC2026 REGS	3,345,000	3,309,710	0.19%
RESONA BANK LTD 4.983% S/A 22JAN2028	250,000	250,847	0.01%
SEKISUI HOUSE LTD 4.7% S/A 23FEB2030	1,000,000	1,002,870	0.06%
SUMITOMO MITSUI FINANCE & LEASING CO LTD 5.236% S/A 01MAY2030	500,000	506,590	0.03%
SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC 5.334% S/A 03MAR2041	2,500,000	2,449,425	0.14%
SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC 6.45% S/A PERP REGS	1,200,000	1,194,408	0.07%
SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC S+1.02% Q 15JAN2032	300,000	300,825	0.02%
SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC S+1.05% Q 07JUL2032	700,000	700,231	0.04%
SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC S+1.05% Q 15APR2030	1,000,000	1,005,000	0.06%
SUMITOMO MITSUI TRUST BANK LTD 4.45% S/A 10SEP2027	900,000	900,000	0.05%
SUMITOMO MITSUI TRUST BANK LTD 4.5% S/A 13MAR2028 REGS	700,000	699,608	0.04%
SUMITOMO MITSUI TRUST BANK LTD S+0.75% Q 11SEP2028	2,900,000	2,909,860	0.16%
SUMITOMO MITSUI TRUST BANK LTD S+0.99% Q 13MAR2030	2,700,000	2,731,806	0.15%
SUMITOMO MITSUI TRUST GROUP INC 5.416% S/A 11SEP2036 REGS	900,000	890,226	0.05%
		112,006,000	6.33%
哈萨克斯坦			
DEVELOPMENT BANK OF KAZAKHSTAN JSC 3.35% A 01SEP2028	4,000,000	601,004	0.03%

华夏精选固定收益配置基金

（华夏精选基金的子基金）

投资组合列表（未审计）（续）

2026年6月30日

上市/挂牌投资	名义数量	公允价值 美元	在资产净值 中的占比
<u>债务证券（续）</u>			
<u>哈萨克斯坦（续）</u>			
KAZMUNAVGAS NATIONAL CO 2.95% S/A 30OCT2030	6,300,000	941,637	0.05%
		1,542,641	0.08%
<u>韩国</u>			
HANA BANK 3.5% S/A PERP REGS	6,834,000	6,805,707	0.38%
HANA BANK 5.75% S/A 24OCT2028 REGS	500,000	513,715	0.03%
HANA SECURITIES CO LTD 4.875% S/A 02JUN2031	1,000,000	992,730	0.06%
HANA SECURITIES CO LTD 5% S/A 30APR2028	1,900,000	1,905,282	0.11%
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD 3.379% S/A 04FEB2032 REGS	1,000,000	991,360	0.06%
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD 6.3% S/A 24JUN2055	4,100,000	4,229,724	0.24%
KB CAPITAL CO LTD 4.25% S/A 01OCT2030	500,000	487,215	0.03%
KEB HANBA BANK S+0.6% Q 21OCT2028	250,000	250,767	0.01%
KODIT GLOBAL 2024-1 LTD 5.357 S/A 29MAY2027	750,000	755,602	0.04%
KOOKMIN BANK 4.375% S/A 08MAY2028 REGS	750,000	748,770	0.04%
KOOKMIN BANK 4.625% S/A 08MAY2030 REGS	650,000	654,063	0.04%
KOREA DEVELOPMENT BANK S+0.76% Q 03FEB2030	750,000	757,928	0.04%
KOREA ELECTRIC POWER CORP 4.75% S/A 13FEB2028 REGS	250,000	251,045	0.01%
KOREA ELECTRIC POWER CORP S+0.62% Q 12NOV2028	400,000	400,732	0.02%
KOREA HOUSING FINANCE CORP 5.125% S/A 21JAN2030 REGS	1,200,000	1,227,684	0.07%
KOREA HOUSING FINANCE CORP S+0.9% Q 21JAN2030 REGS	1,200,000	1,212,324	0.07%
KOREA INVESTMENT & SECURITIES CO LTD 6.875% S/A 06NOV2026	1,900,000	1,913,281	0.11%
KOREA MINE REHABILITATION & MINERAL RESOURCES CORP 4.875% S/A 13APR2031	1,700,000	1,711,016	0.10%
KOREA NATIONAL OIL CORP 3M S+0.83% Q 03APR2027	750,000	751,838	0.04%
KOREA NATIONAL OIL CORP 3M S+0.9% Q 30SEP2027	500,000	502,245	0.03%
KOREA NATIONAL OIL CORP 4.5% S/A 30MAR2029 REGS	400,000	399,532	0.02%
KOREA NATIONAL OIL CORP 4.625% S/A 30MAR2031 REGS	300,000	300,426	0.02%
KOREA NATIONAL OIL CORP S+0.67% Q 29SEP2028	500,000	500,905	0.03%
KOREA OCEAN BUSINESS CORP 4.625% S/A 09MAY2030	1,300,000	1,303,276	0.07%
KOREA TOBACCO & GINSENG CORP 5% S/A 02MAY2028	250,000	251,660	0.01%
KOREA WATER RESOURCES CORP 4.375% S/A 21MAY2027	500,000	499,670	0.03%
KYOBO LIFE INSURANCE CO 5.9% S/A PERP REGS	10,710,000	10,820,527	0.61%
LG ENERGY SOLUTION 5% S/A 02APR2029 REGS	2,200,000	2,201,650	0.12%
LG ENERGY SOLUTION 5.25% S/A 02APR2028 REGS	1,250,000	1,257,875	0.07%
LG ENERGY SOLUTION 5.25% S/A 02APR2031 REGS	500,000	500,460	0.03%

华夏精选固定收益配置基金

（华夏精选基金的子基金）

投资组合列表（未审计）（续）

2026年6月30日

上市/挂牌投资	名义数量	公允价值 美元	在资产净值 中的占比
<u>债务证券（续）</u>			
韩国（续）			
LG ENERGY SOLUTION 5.375% S/A 02APR2030 REGS	4,250,000	4,292,500	0.24%
LG ENERGY SOLUTION 5.375% S/A 02JUL2027 REGS	500,000	503,210	0.03%
LG ENERGY SOLUTION 5.875% S/A 02APR2035 REGS	2,250,000	2,295,675	0.13%
LOTTE PROPERTY & DEVELOPMENT CO LTD 4.375% S/A 14JUL2028	1,000,000	994,220	0.06%
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD 4.375% S/A 14OCT2028	1,000,000	987,000	0.06%
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD 5.5% S/A 31UL2027	500,000	503,910	0.03%
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD 5.875% S/A 26JAN2027	200,000	201,274	0.01%
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD 6% S/A 26JAN2029	700,000	716,408	0.04%
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD 6.875% S/A 26JUL2026	1,500,000	1,502,115	0.08%
NAVER CORP 4.375% S/A 21APR2031	700,000	691,894	0.04%
NH INVESTMENT & SECS 4.625% S/A 10JUL2028	250,000	249,168	0.01%
NH INVESTMENT & SECS 5% S/A 29JUN2031	1,250,000	1,247,275	0.07%
POSCO HOLDINGS INC 5.125% S/A 07MAY2030 REGS	500,000	504,215	0.03%
POSCO INTERNATIONAL CORP 5.125% S/A 29JUN2031	820,000	818,229	0.05%
SHINHAN BANK CO LTD 5.75% S/A 15APR2034 REGS	1,000,000	1,036,030	0.06%
SK HYNIX INC 6.375% S/A 17JAN2028 REGS	800,000	821,312	0.05%
SK ON CO LTD 4.375% S/A 07MAY2029	600,000	595,638	0.03%
TONGYANG LIFE INSURANCE CO LTD 6.25% S/A 07MAY2035	4,500,000	4,642,155	0.26%
WOORI BANK 6.375% S/A PERP REGS	200,000	207,068	0.01%
		67,908,305	3.83%
卢森堡			
ARGENTUM NETHERLANDS BV FOR SWISS RE LTD 5.524% A PERP	4,930,000	4,951,199	0.28%
NEXA RESOURCES SA 6.6% S/A 08APR2037 REGS	1,300,000	1,350,752	0.08%
		6,301,951	0.36%
马来西亚			
AFFIN BANK BHD 5.112% S/A 04JUN2030	1,000,000	1,006,530	0.06%
PETRONAS CAPITAL LTD 4.95% S/A 03JAN2031 REGS	1,500,000	1,521,810	0.09%
PETRONAS CAPITAL LTD 5.34% S/A 03APR2035	1,000,000	1,028,850	0.06%
		3,557,190	0.21%
毛里求斯			
GREENKO WIND PROJECTS MAURITIUS LTD 7.25% S/A 27SEP2028 REGS	1,100,000	1,092,926	0.06%
		1,092,926	0.06%
墨西哥			
BBVA BANCOMER SA/TEXAS 7.625% S/A 11FEB2035 REGS	200,000	206,858	0.01%

华夏精选固定收益配置基金

（华夏精选基金的子基金）

投资组合列表（未审计）（续）

2026年6月30日

上市/挂牌投资	名义数量	公允价值 美元	在资产净值 中的占比
<u>债务证券（续）</u>			
墨西哥（续）			
MEXICO GOVERNMENT INTL BOND 6% S/A 13MAY2030	500,000	514,940	0.03%
MEXICO GOVERNMENT INTL BOND 6.875% S/A 13MAY2037	1,000,000	1,050,560	0.06%
		1,772,358	0.10%
荷兰			
DEMETER INVESTMENTS BV FOR SWISS RE LTD 5.625% A 15AUG2052	7,100,000	7,139,618	0.40%
ING GROEP NV 5.75% S/A PERP	8,600,000	8,624,596	0.49%
ING GROEP NV 7.25% S/A PERP	1,000,000	1,050,540	0.06%
ING GROEP NV S+1.01% Q 25MAR2029	1,500,000	1,507,710	0.09%
MERRILL LYNCH BV 2.7% A 25JUL2035	3,000,000	441,807	0.02%
PROSUS NV 3.68% S/A 21JAN2030 REGS	800,000	765,416	0.04%
		19,529,687	1.10%
菲律宾			
PHILIPPINE GOVERNMENT INTL BOND 5.25% S/A 24JUN2036	800,000	804,376	0.05%
		804,376	0.05%
卡塔尔			
QIIB TIER 1 SUKUK LLC 5.45% S/A PERP	500,000	496,950	0.03%
		496,950	0.03%
沙特阿拉伯			
SAUDI GOVERNMENT INTL BOND 5.625% S/A 13JAN2035 REGS	1,600,000	1,660,080	0.09%
		1,660,080	0.09%
新加坡			
BOC AVIATION LTD 4.375% S/A 12JAN2033 REGS	2,000,000	1,973,340	0.11%
CATHAYLIFE SINGAPORE PTE LTD 5.5% S/A 29APR2041	2,000,000	1,979,580	0.11%
CATHAYLIFE SINGAPORE PTE LTD 5.95% S/A 05JUL2034	900,000	941,472	0.05%
EVERGREEN MARINE ASIA PTE LTD 5.25% S/A 23APR2029	1,200,000	1,197,384	0.07%
JOLLIBEE WORLDWIDE PTE LTD 5.332% S/A 02APR2030	700,000	713,069	0.04%
MEDCO CYPRESS TREE PTE LTD 8.625% S/A 19MAY2030	250,000	261,058	0.01%
NANSHAN LIFE PTE LTD 5.45% S/A 11SEP2034	200,000	194,856	0.01%
NANSHAN LIFE PTE LTD 5.875% S/A 17MAR2041	400,000	391,932	0.02%
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP LTD 5.52% S/A 21MAY2034	200,000	203,840	0.01%
SHIN KONG LIFE SG PTE 6.95% S/A 26JUN2035	1,000,000	1,048,380	0.06%
SINGAPORE AIRLINES LTD 5.25% S/A 21MAR2034	800,000	817,520	0.05%
TEMASEK FINANCIAL I LTD 2.05% S/A 30JUL2035	10,000,000	1,460,421	0.08%
TEMASEK FINANCIAL I LTD 2.55% S/A 30JUL2055 REGS	13,000,000	1,808,605	0.10%

华夏精选固定收益配置基金

（华夏精选基金的子基金）

投资组合列表（未审计）（续）

2026年6月30日

上市/挂牌投资	名义数量	公允价值 美元	在资产净值 中的占比
<u>债务证券（续）</u>			
<u>新加坡（续）</u>			
TEMASEK FINANCIAL I LTD 3.1% S/A 28AUG2054	3,000,000	464,918	0.03%
		13,456,375	0.75%
<u>西班牙</u>			
BANCO SANTANDER SA 4.75% Q PERP	12,000,000	11,991,240	0.68%
BANCO SANTANDER SA 5.565% S/A 17JAN2030	3,400,000	3,486,054	0.20%
BANCO SANTANDER SA 5.8% S/A 05APR2029	200,000	200,498	0.01%
CAIXABANK SA 4.818% S/A 22APR2032	400,000	397,336	0.02%
		16,075,128	0.91%
<u>瑞典</u>			
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB 6.75% S/A PERP	1,000,000	1,029,750	0.06%
		1,029,750	0.06%
<u>瑞士</u>			
JULIUS BAER GROUP LTD 7.5% S/A PERP	400,000	416,244	0.02%
UBS GROUP AG 4.875% S/A PERP REGS	2,000,000	1,995,060	0.11%
UBS GROUP AG 5.125% A PERP	8,500,000	8,507,055	0.48%
UBS GROUP AG 7% S/A PERP REGS	1,000,000	1,017,350	0.06%
UBS GROUP AG 9.25% S/A PERP	400,000	430,840	0.02%
UBS GROUP AG S+1.06% Q 23SEP2031	3,000,000	3,014,640	0.17%
UBS GROUP FUNDING SWITZERLAND AG 6.6% S/A PERP	1,750,000	1,766,555	0.10%
UBS GROUP FUNDING SWITZERLAND AG 6.875% S/A PERP	400,000	461,360	0.03%
		17,609,104	0.99%
<u>泰国</u>			
BANGKOK BANK PCL 3.466% S/A 23SEP2036 REGS	500,000	455,245	0.03%
BANGKOK BANK PCL/HONG KONG 3.733% S/A 25SEP2034 REGS	3,159,000	3,010,022	0.17%
		3,465,267	0.20%
<u>阿联酋</u>			
EMIRATES NBD BANK PJSC 5.141% S/A 26NOV2029	900,000	904,734	0.05%
		904,734	0.05%
<u>英国</u>			
ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC 4.625% S/A 19MAR2031 REGS	640,000	631,853	0.04%
AZULE ENERGY FINANCE PLC 8.25% S/A 22JAN2031	750,000	751,553	0.04%
AZULE ENERGY FINANCE PLC 8.625% S/A 22JAN2033	750,000	753,503	0.04%
BARCLAYS PLC 4.375% Q PERP	3,000,000	2,912,190	0.16%
BARCLAYS PLC S+1.01% Q 11NOV2029	800,000	805,256	0.05%
CSL FINANCE PLC 4.25% S/A 27APR2032	1,000,000	962,540	0.05%

华夏精选固定收益配置基金

（华夏精选基金的子基金）

投资组合列表（未审计）（续）

2026年6月30日

上市/挂牌投资	名义数量	公允价值 美元	在资产净值 中的占比
<u>债务证券（续）</u>			
英国（续）			
CSL FINANCE PLC 4.75% S/A 27APR2052	1,280,000	1,100,250	0.06%
HSBC HLDGS PLC 3M S+1.03% Q 03MAR2029	1,600,000	1,608,592	0.09%
HSBC HLDGS PLC 3M S+1.04% Q 19NOV2028	1,000,000	1,004,680	0.06%
HSBC HLDGS PLC 3M S+1.19% Q 06NOV2031	1,300,000	1,310,192	0.07%
HSBC HLDGS PLC 3M S+1.29% Q 03MAR2031	1,200,000	1,213,620	0.07%
HSBC HLDGS PLC 3M S+1.57% Q 13MAY2031	1,400,000	1,430,282	0.08%
HSBC HLDGS PLC 5.741% S/A 10SEP2036	1,400,000	1,415,022	0.08%
HSBC HLDGS PLC 6.875% S/A PERP	800,000	820,384	0.05%
HSBC HLDGS PLC 6.95% S/A PERP	500,000	509,655	0.03%
HSBC USA INC 4.65% S/A 06JUN2028	2,000,000	2,005,460	0.11%
MITSUBISHI HC CAPITAL UK PLC 5.302% S/A 23JAN2028	550,000	554,103	0.03%
NATWEST GROUP PLC 4.983% S/A 18JUN2032	1,500,000	1,501,380	0.08%
NATWEST GROUP PLC 5.115% S/A 23MAY2031	3,800,000	3,832,528	0.22%
ROTHESAY LIFE PLC 4.875% S/A PERP	2,000,000	1,987,480	0.11%
SANTANDER UK GROUP HLDGS PLC 6.534% S/A 10JAN2029	3,000,000	3,081,300	0.17%
STANDARD CHARTERED PLC 5.005% S/A 15OCT2030 REGS	1,000,000	1,004,820	0.06%
STANDARD CHARTERED PLC 5.545% S/A 21JAN2029	1,000,000	1,012,180	0.06%
STANDARD CHARTERED PLC 7.625% S/A PERP REGS	1,500,000	1,579,785	0.09%
STANDARD CHARTERED PLC 7.75% S/A PERP REGS	350,000	359,839	0.02%
STANDARD CHARTERED PLC L+1.51% Q PERP	1,000,000	978,910	0.06%
STANDARD CHARTERED PLC S+1.24% Q 21JAN2029 REGS	3,000,000	3,022,320	0.17%
STANDARD CHARTERED PLC S+1.93% Q 06JUL2027 REGS (CALLED)	1,000,000	1,000,200	0.06%
		39,149,877	2.21%
美国			
BANK OF NEW YORK MELLON 4.729% S/A 20APR2029	1,000,000	1,004,100	0.06%
BOC AVIATION USA CORP 4.75% S/A 14JAN2028	2,500,000	2,507,225	0.14%
BRIGHT FOOD SINGAPORE HLDGS PTE CO LTD 3.25% A 09JUL2030	1,000,000	1,134,304	0.06%
CHUBB INA HOLDINGS LLC 2.4% S/A 14MAY2031	5,000,000	740,770	0.04%
CHUBB INA HOLDINGS LLC 2.5% S/A 06AUG2030	6,000,000	892,776	0.05%
CHUBB INA HOLDINGS LLC 2.75% S/A 06AUG2035	12,000,000	1,766,396	0.10%
CHUBB INA HOLDINGS LLC 2.85% S/A 14MAY2036	8,000,000	1,185,161	0.07%
CHUBB INA HOLDINGS LLC 3.05% S/A 06AUG2055	4,000,000	568,051	0.03%
GENERAL MOTORS CO 5.625% S/A 15APR2030	500,000	512,100	0.03%
GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 5% S/A 15JUL2027	1,500,000	1,507,560	0.09%
GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 5.45% S/A 15JUL2030	2,250,000	2,293,875	0.13%

华夏精选固定收益配置基金

（华夏精选基金的子基金）

投资组合列表（未审计）（续）

2026年6月30日

上市/挂牌投资	名义数量	公允价值 美元	在资产净值 中的占比
<u>债务证券（续）</u>			
美国（续）			
GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 5.8% S/A 07JAN2029	1,500,000	1,535,100	0.09%
HCA INC 5% S/A 01MAR2028	1,000,000	1,005,580	0.06%
HCA INC 5.25% S/A 01MAR2030	1,000,000	1,013,200	0.06%
JOHNSON & JOHNSON S/A 3.4% 15JAN2038	1,700,000	1,469,463	0.08%
JPMORGAN CHASE BANK NA 5.2% A 19MAR2036	10,000,000	10,000,000	0.56%
JPMORGAN CHASE BANK NA 5.6% A 11FEB2046	10,000,000	10,000,000	0.56%
KIMCO REALTY OP LLC 5.3% S/A 01FEB2036	400,000	403,804	0.02%
KUBOTA CREDIT CORP USA 4.737% S/A 27MAY2029	500,000	499,745	0.03%
KUBOTA CREDIT CORP USA 4.791% S/A 28MAY2028	500,000	500,435	0.03%
MORGAN STANLEY BANK NA S+1.165% Q 30OCT2026	1,200,000	1,202,064	0.07%
PROLOGIS LP 3.25% S/A 11SEP2029	5,000,000	753,295	0.04%
PRUDENTIAL FINANCIAL INC 5.7% S/A 15SEP2048	1,000,000	1,001,570	0.06%
RESORTS WORLD LAS VEGAS LLC/RWLV CAPITAL INC 4.625% S/A 16APR2029 REGS	1,000,000	898,230	0.05%
SHELL FINANCE US INC S+0.78% S/A 06NOV2030	2,000,000	2,019,260	0.11%
SK BATTERY AMERICA INC 4.25% S/A 22JAN2029	1,800,000	1,782,540	0.10%
WELLS FARGO FINANCE LLC 5.55% A 14NOV2034	5,000,000	5,000,000	0.28%
WELLS FARGO FINANCE LLC 5.6% A 18NOV2034	5,000,000	5,000,000	0.28%
		58,196,604	3.28%
乌兹别克斯坦			
NAVOI MINING & METALLURGICAL COMBINAT 6.7% S/A 17OCT2028 REGS	400,000	423,152	0.02%
		423,152	0.02%
英属维尔京群岛			
AMIPEACE LTD 1.88% S/A 29APR2029	3,000,000	442,624	0.02%
AMIPEACE LTD 2.02% S/A 29APR2031	4,000,000	590,866	0.03%
CELESTIAL DYNASTY LTD 6.375% S/A 22AUG2029	2,520,000	2,508,912	0.14%
CENTRAL INTL DEVELOPMENT BVI LTD 5.1% S/A 19AUG2027	500,000	502,780	0.03%
CENTRAL PLAZA DEVELOPMENT LTD 7.15% S/A 21MAR2028	550,000	554,587	0.03%
CFAMC II CO LTD 4.875% S/A 22NOV2026	11,798,000	11,806,849	0.67%
CFAMC III CO LTD 4.25% S/A 07NOV2027	13,500,000	13,390,650	0.76%
CHANG DEVELOPMENT INTL LTD 4.9% S/A 06MAR2029	700,000	699,097	0.04%
CHANG DEVELOPMENT INTL LTD 6.25% S/A 26MAR2028	3,200,000	3,269,472	0.18%
CHANG DEVELOPMENT INTL LTD 6.8% S/A 25JUN2027	5,000,000	5,099,050	0.29%
CHARMING LIGHT INVESTMENTS LTD 4.375% S/A 21DEC2027	5,700,000	5,677,086	0.32%
CHINA CINDA 2020 I MANAGEMENT LTD 2.58% S/A 25JUN2028	20,000,000	2,970,649	0.17%

华夏精选固定收益配置基金

(华夏精选基金的子基金)

投资组合列表 (未审计) (续)

2026年6月30日

上市/挂牌投资	名义数量	公允价值 美元	在资产净值 中的占比
<u>债务证券 (续)</u>			
英属维尔京群岛 (续)			
CHINA CINDA 2020 I MANAGEMENT LTD 3.25% S/A 28JAN2027	10,000,000	9,923,800	0.56%
CHINA CINDA 2020 I MANAGEMENT LTD 4.375% S/A 13NOV2028	900,000	894,384	0.05%
CHINA CINDA 2020 I MANAGEMENT LTD 5.75% S/A 28MAY2029	1,000,000	1,026,090	0.06%
CHINA CINDA 2020 I MANAGEMENT LTD S+1% Q 13NOV2030	600,000	604,848	0.03%
CHINA CINDA FINANCE 2017 I LTD 4.75% S/A 21FEB2029	1,000,000	1,001,370	0.06%
CHINA GREAT WALL INTL HLDGS III LTD 3.875% S/A 31AUG2027	2,000,000	1,980,100	0.11%
CHINA GREAT WALL INTL HLDGS VI LTD 6.375% S/A 02JAN2028	3,100,000	3,165,286	0.18%
CHINA GREAT WALL INTL HLDGS VI LTD 7.15% S/A PERP	600,000	615,030	0.03%
CHINA RESOURCES LAND LTD 2.4% S/A 20NOV2030	9,900,000	1,452,553	0.08%
CHOUZHOU INTL INVESTMENT LTD 4.8% S/A 15JAN2028	600,000	601,980	0.03%
COASTAL EMERALD LTD 6.5% S/A PERP	2,000,000	2,036,800	0.11%
CONTEMPORARY RUIDING DEVELOPMENT LTD 2.625% S/A 17SEP2030	910,000	842,214	0.05%
FORTUNE STAR BVI LTD 5.05% S/A 27JAN2027	2,750,000	2,727,890	0.15%
FORTUNE STAR BVI LTD 6.8% S/A 09SEP2029	1,300,000	1,287,013	0.07%
FORTUNE STAR BVI LTD 8.5% S/A 19MAY2028	1,000,000	1,027,890	0.06%
HONGKONG ELECTRIC FINANCE LTD 4.75% S/A 03FEB2036	3,550,000	3,529,836	0.20%
HUARONG FINANCE 2017 CO LTD 4.75% S/A 27APR2027	15,128,000	15,124,521	0.85%
HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 3.375% S/A 24FEB2030	13,641,000	12,932,623	0.73%
HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 3.625% S/A 30SEP2030	3,800,000	3,610,494	0.20%
HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 3.875% S/A 13NOV2029	4,100,000	3,974,663	0.22%
HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 4.5% S/A 29MAY2029	8,180,000	8,097,300	0.46%
JOY DELIGHT INTERNATIONAL LTD 3.3% S/A 03NOV2028	10,000,000	1,457,903	0.08%
JOY TREASURE ASSETS HLDGS INC 4.3% S/A 04DEC2028	1,600,000	1,587,088	0.09%
JOY TREASURE ASSETS HLDGS INC 5.5% S/A 1FEB2027	5,700,000	5,716,188	0.32%
JUNFENG INTERNATIONAL CO LTD 5.6% S/A 21OCT2027	1,500,000	1,514,835	0.09%
NAN FUNG TREASURY LTD 5.75% S/A 21MAY2036	600,000	594,624	0.03%
PEAK RE BVI HLDG LTD 5.625% S/A PERP	4,850,000	4,857,809	0.27%
SF HLDG INVESTMENT 2021 LTD 3.125% S/A 17NOV2031	500,000	467,345	0.03%
SJM INTL LTD 6.5% S/A 15JAN2031	1,100,000	1,044,582	0.06%
STUDIO CITY CO LTD 6.125% S/A 15MAY2031 REGS	200,000	198,228	0.01%
TENCENT HOLDINGS LTD 3.1% S/A 23SEP2055	2,000,000	297,153	0.02%
VERTEX CAPITAL INVESTMENT LTD 2.8% S/A 11MAR2029	3,000,000	442,871	0.02%

华夏精选固定收益配置基金

（华夏精选基金的子基金）

投资组合列表（未审计）（续）

2026年6月30日

上市/挂牌投资	名义数量	公允价值 美元	在资产净值 中的占比
<u>债务证券（续）</u>			
英属维尔京群岛（续）			
YIELDKING INVESTMENT LTD 2.8% S/A 18AUG2026	5,000,000	4,984,900	0.28%
YUEXIU REIT MTN CO LTD 6.5% S/A 12FEB2029	600,000	612,000	0.03%
ZHONGYUAN ZHICHENG CO LTD 2.35% S/A 29JUN2029	5,600,000	825,093	0.05%
		148,569,926	8.35%

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合列表 (未审计) (续)

2026年6月30日

未上市/挂牌投资	名义数量	公允价值 美元	在资产净值 中的占比
<u>债务证券</u>			
澳大利亚			
APA INFRASTRUCTURE LTD 5.125% S/A 16SEP2034 REGS	1,000,000	993,690	0.06%
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD S+0.59% Q 08DEC2028 REGS	2,000,000	2,004,980	0.11%
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD S+0.68% Q 08DEC2030 REGS	4,000,000	4,016,200	0.23%
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD S+0.85% Q 16DEC2029 REGS	1,000,000	1,009,990	0.06%
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 5.929% S/A 14MAR2046	1,000,000	1,016,450	0.06%
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA S+0.78% Q 01OCT2030 REGS	2,000,000	2,015,660	0.11%
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA S+0.81% Q 14MAR2030 REGS	600,000	605,088	0.03%
MACQUARIE BANK LTD S+0.74% Q 12JUN2028 REGS	500,000	502,485	0.03%
MACQUARIE BANK LTD S+1.2% Q 07DEC2026 REGS	500,000	501,800	0.03%
MACQUARIE BANK LTD/LONDON 6.125% S/A PERP REGS	8,000,000	8,059,600	0.45%
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 5.902% S/A 14JAN2036 REGS	2,000,000	2,061,080	0.12%
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD S+0.79% Q 14JAN2030	1,350,000	1,359,612	0.08%
NATL AUST BK/NY 4.901% S/A 14JAN2030	2,400,000	2,439,240	0.14%
QANTAS AIRWAYS 6.659% S/A 19MAY2036	3,000,000	2,108,336	0.12%
SANTOS FINANCE LTD 5.75% S/A 13NOV2035 REGS	3,400,000	3,448,076	0.19%
WESTPAC BANKING CORP S+0.71% Q 12JUN2031	600,000	601,404	0.03%
WOODSIDE FINANCE LTD 5.4% S/A 19MAY2030	600,000	611,484	0.03%
WOODSIDE FINANCE LTD 6% S/A 19MAY2035	1,500,000	1,568,610	0.09%
		34,923,785	1.97%
加拿大			
BANK OF MONTREAL 6.875 Q 26NOV2085	6,000,000	6,107,940	0.34%
BANK OF NOVA SCOTIA 3M TS+2.90961% Q PERP	900,000	897,192	0.05%
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 4.862% S/A 13JAN2028	2,000,000	2,004,420	0.11%
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 5.245% S/A 13JAN2031	2,000,000	2,028,360	0.11%
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 6.5% Q 28JUL2086	1,800,000	1,802,232	0.10%
ENBRIDGE INC 4.6% S/A 20JUN2028	300,000	300,204	0.02%
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD 5.75% S/A 20MAY2035	3,300,000	3,370,488	0.19%
		16,510,836	0.92%
开曼群岛			
GACI FIRST INVESTMENT CO 5.25% S/A 14MAY2033	1,000,000	999,350	0.06%
MA'ADEN SUKUK LTD 5.25% S/A 13FEB2030	600,000	604,044	0.03%

华夏精选固定收益配置基金

（华夏精选基金的子基金）

投资组合列表（未审计）（续）

2026年6月30日

未上市/挂牌投资	名义数量	公允价值 美元	在资产净值 中的占比
<u>债务证券（续）</u>			
开曼群岛（续）			
MELCO RESORTS FINANCE LTD 7.625% S/A 17APR2032 REGS	2,000,000	2,050,460	0.12%
		3,653,854	0.21%
智利			
AES ANDES SA 6.25% S/A 14MAR2032	500,000	517,355	0.03%
CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE 6.44% S/A 26JAN2036 REGS	750,000	797,235	0.04%
		1,314,590	0.07%
芬兰			
NORDEA BANK ABP 6.75% S/A PERP	1,900,000	1,919,950	0.11%
		1,919,950	0.11%
法国			
BNP PARIBAS SA 5.786% S/A 13JAN2033 REGS	7,000,000	7,235,690	0.41%
BNP PARIBAS SA 5.8% A 22MAY2036	2,000,000	2,000,000	0.11%
BNP PARIBAS SA 6% A 04JUN2036	3,000,000	3,000,000	0.17%
CREDIT AGRICOLE SA 4.656% S/A 12JAN2032	1,500,000	1,478,370	0.08%
CREDIT AGRICOLE SA 4.75% Q PERP REGS	2,850,000	2,766,638	0.16%
CREDIT AGRICOLE SA 5.222% S/A 27MAY2031	1,500,000	1,514,700	0.09%
CREDIT AGRICOLE SA 5.23% S/A 09JAN2029	2,100,000	2,117,514	0.12%
CREDIT AGRICOLE SA 5.862% S/A 09JAN2036	2,000,000	2,066,360	0.12%
CREDIT AGRICOLE SA S+1.13% Q 09JAN2029 REGS	2,100,000	2,111,487	0.12%
ELECTRICITE DE FRANCE SA 5.75% S/A 13JAN2035	1,500,000	1,551,450	0.09%
SOCIETE GENERALE SA %BW+1.4 Q 30JUN2032	600,000	413,527	0.02%
SOCIETE GENERALE SA 5.249% S/A 22MAY2029 REGS	1,500,000	1,511,625	0.09%
SOCIETE GENERALE SA 5.439% S/A 03OCT2036 REGS	2,000,000	1,978,380	0.11%
SOCIETE GENERALE SA 5.5% S/A 13APR2029 REGS	7,000,000	7,081,550	0.40%
SOCIETE GENERALE SA 5.512% S/A 22MAY2031 REGS	1,300,000	1,321,827	0.07%
SOCIETE GENERALE SA 6.1% S/A 13APR2033 REGS	2,800,000	2,914,408	0.16%
SOCIETE GENERALE SA 8.125% S/A PERP	950,000	998,165	0.06%
		42,061,691	2.38%
德国			
ALLIANZ SE 5.6% S/A 3SEP2054 REGS	3,000,000	3,000,540	0.17%
DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK 5.353% S/A 10JAN2029	3,900,000	3,937,791	0.22%
		6,938,331	0.39%
中国香港			
MTR CORP LTD 4.886% S/A 29JAN2031	300,000	207,144	0.01%

华夏精选固定收益配置基金

（华夏精选基金的子基金）

投资组合列表（未审计）（续）

2026年6月30日

未上市/挂牌投资	名义数量	公允价值 美元	在资产净值 中的占比
<u>债务证券（续）</u>			
中国香港（续）			
MTR CORP LTD 5.582% S/A 29JAN2038	300,000	206,538	0.01%
		413,682	0.02%
印度尼西亚			
INDONESIA GOVERNMENT INTL BOND 4.4% S/A 14AUG2030	1,000,000	674,109	0.04%
REPUBLIC OF INDONESIA 5.3% S/A 14AUG2035	1,200,000	816,976	0.05%
		1,491,085	0.09%
爱尔兰			
CRH SMW FINANCE DAC 5.125% S/A 09JAN2030	500,000	507,325	0.03%
SMBC AVIATION CAPITAL FINANCE DAC 5.1% S/A 01APR2030 REGS	750,000	754,283	0.04%
		1,261,608	0.07%
意大利			
INTESA SANPAOLO SPA 5% S/A 29JUN2030	350,000	350,819	0.02%
INTESA SANPAOLO SPA 6.005% S/A 29JUN2037 REGS	250,000	252,485	0.01%
SNAM SPA 5.75% S/A 28MAY2035	900,000	928,134	0.05%
		1,531,438	0.08%
日本			
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 6.35% S/A PERP	5,000,000	4,997,350	0.28%
RAKUTEN GROUP INC 11.25% S/A 15FEB2027	500,000	517,395	0.03%
SUMITOMO LIFE INSURANCE CO 4% S/A 14SEP2077 REGS	3,604,000	3,571,816	0.20%
		9,086,561	0.51%
韩国			
LG ENERGY SOLUTION S+1.7% Q 02APR2030	400,000	406,100	0.02%
		406,100	0.02%
卢森堡			
CHILE ELECTRICITY LUX 5.672% S/A 20OCT2035 REGS	500,000	494,591	0.03%
NESTLE FINANCE INTL LTD 2.8% A 29MAY2035 REGS	14,000,000	2,103,309	0.12%
		2,597,900	0.15%
墨西哥			
BANCO SANTANDER MEXICO SA 5.621% S/A 10DEC2029 REGS	900,000	918,351	0.05%
COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD 6.45% S/A 24JAN2035	900,000	901,386	0.05%
		1,819,737	0.10%
荷兰			
ING GROEP NV 7% S/A PERP	1,200,000	1,235,400	0.07%

华夏精选固定收益配置基金

(华夏精选基金的子基金)

投资组合列表 (未审计) (续)

2026年6月30日

未上市/挂牌投资	名义数量	公允价值 美元	在资产净值 中的占比
<u>债务证券 (续)</u>			
荷兰 (续)			
JBS NV/USA FOODS/FOOD CO 5.95% S/A 20APR2035	1,500,000	1,551,615	0.09%
SIEMENS FUNDING BV 4.9% S/A 28MAY2032	700,000	709,562	0.04%
SYNGENTA FINANCE NV 5.182% S/A 24APR2028 REGS	300,000	301,257	0.02%
		3,797,834	0.22%
新西兰			
BANK OF NEW ZEALAND 2.87% S/A 27JAN2032 REGS	500,000	455,730	0.03%
BANK OF NEW ZEALAND 5.698% S/A 28JAN2035 REGS	3,000,000	3,054,390	0.17%
WESTPAC NEW ZEALAND LTD 4.938% S/A 27FEB2030 REGS	1,000,000	1,010,280	0.06%
		4,520,400	0.26%
秘鲁			
BANCO DE CREDITO DEL PERU 6.45% S/A 30JUL2035 REGS	1,800,000	1,856,142	0.10%
		1,856,142	0.10%
沙特阿拉伯			
SAUDI GOVERNMENT INTL BOND 5.125% S/A 13JAN2028 REGS	3,400,000	3,422,814	0.19%
SAUDI GOVERNMENT INTL BOND 5.375% S/A 13JAN2031 REGS	2,000,000	2,040,340	0.12%
		5,463,154	0.31%
新加坡			
NOMURA INTERNATIONAL FUNDING PTE LTD 2.82% A 28JUL2035	20,000,000	2,945,378	0.17%
NOMURA INTERNATIONAL FUNDING PTE LTD 5.12% A 21JAN2036	5,000,000	5,000,000	0.28%
NOMURA INTERNATIONAL FUNDING PTE LTD 5.17% A 23JAN2036	5,000,000	5,000,000	0.28%
NOMURA INTERNATIONAL FUNDING PTE LTD 5.33% A 28APR2036	5,000,000	5,000,000	0.28%
NOMURA INTERNATIONAL FUNDING PTE LTD 5.4% A 11DEC2034	6,000,000	6,000,000	0.34%
NOMURA INTERNATIONAL FUNDING PTE LTD 5.8% A 10FEB2035	5,000,000	5,000,000	0.28%
		28,945,378	1.63%
西班牙			
BANCO SANTANDER SA S+1.38% Q 14MAR2028	1,000,000	1,004,980	0.06%
		1,004,980	0.06%
超国家			
INTL BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT 4.75% A 21AUG2035	5,000,000	4,946,700	0.28%
		4,946,700	0.28%
阿联酋			
EMIRATES NBD BANK PJSC 2.98% A 11JUL2035	10,000,000	1,459,361	0.08%
		1,459,361	0.08%

华夏精选固定收益配置基金

（华夏精选基金的子基金）

投资组合列表（未审计）（续）

2026年6月30日

未上市/挂牌投资	名义数量	公允价值 美元	在资产净值 中的占比
<u>债务证券（续）</u>			
英国			
HSBC BANK PLC 5.5% A 14NOV2034	5,000,000	5,000,000	0.28%
HSBC BANK PLC 5.5% A 18NOV2034	5,000,000	5,000,000	0.28%
HSBC BANK PLC 5.5% A 21NOV2034	5,000,000	5,000,000	0.28%
HSBC BANK PLC 5.75% A 22NOV2034	5,000,000	5,000,000	0.28%
HSBC HLDGS PLC 3M S+1.21% Q 10MAR2032	2,400,000	2,418,000	0.14%
HSBC HLDGS PLC 5.24% S/A 13MAY2031	900,000	910,854	0.05%
HSBC HLDGS PLC 5.79% S/A 13MAY2036	1,000,000	1,033,500	0.06%
HSBC HLDGS PLC 7.05% S/A PERP	3,350,000	3,438,976	0.19%
RIO TINTO FINANCE USA PLC 4.875% S/A 14MAR2030	1,000,000	1,010,110	0.06%
RIO TINTO FINANCE USD PLC S+0.84% Q 14MAR2028	2,500,000	2,514,875	0.14%
		31,326,315	1.76%
美国			
ABBVIE INC 4.65% S/A 15MAR2028	3,500,000	3,514,280	0.20%
ABBVIE INC 4.875% S/A 15MAR2030	2,500,000	2,526,275	0.14%
ARES CAPITAL CORP 7% S/A 15JAN2027	800,000	808,768	0.05%
ARROW ELECTRONICS INC 5.15% S/A 21AUG2029	350,000	352,716	0.02%
ATHENE GLOBAL FUNDING 4.95% S/A 07JAN2027 REGS	3,000,000	3,004,890	0.17%
ATHENE GLOBAL FUNDING 5.133% S/A 01JUN2029	1,300,000	1,303,289	0.07%
ATHENE GLOBAL FUNDING 5.526% S/A 07JAN2030	2,500,000	2,512,325	0.14%
ATMOS ENERGY CORP 5.2% S/A 15AUG2035	1,800,000	1,821,960	0.10%
BANK OF NEW YORK MELLON CORP 5.316% S/A 06JUN2036	600,000	606,486	0.03%
BAT CAPITAL CORP 5.834% S/A 20FEB2031	300,000	312,084	0.02%
BOSTON GAS CO 5.843% S/A 10JAN2035	300,000	311,949	0.02%
BROADCOM INC 5.2% S/A 15APR2032	700,000	712,544	0.04%
BROADCOM INC 5.2% S/A 15JUL2035	1,500,000	1,503,960	0.08%
CATERPILLAR FINANCIAL SERVICES CORP 5% S/A 14MAY2027	500,000	503,295	0.03%
CATERPILLAR INC 5.2% S/A 15MAY2035	1,000,000	1,019,280	0.06%
CBRE SERVICES INC 4.8% S/A 15JUN2030	1,500,000	1,498,875	0.08%
CENCORA INC 4.625% S/A 15DEC2027	500,000	500,700	0.03%
CENTERPOINT ENERGY HOUSTON ELECTRIC LLC 4.8% S/A 15MAR2030	500,000	502,985	0.03%
CHENIERE ENERGY PARTNERS LP 5.55% S/A 30OCT2035	250,000	253,808	0.01%
CHPE LLC 5.35% S/A 30JUN2036	950,000	947,264	0.05%
CITADEL LP 6% S/A 23JAN2030 REGS	350,000	359,310	0.02%
CITIBANK NA 4.838% S/A 06AUG2029	1,000,000	1,007,680	0.06%

华夏精选固定收益配置基金

（华夏精选基金的子基金）

投资组合列表（未审计）（续）

2026年6月30日

未上市/挂牌投资	名义数量	公允价值 美元	在资产净值 中的占比
<u>债务证券（续）</u>			
美国（续）			
CITIBANK NA 4.929% S/A 06AUG2026 (CALLED)	1,000,000	1,000,540	0.06%
CITIBANK NA 5.57% S/A 30APR2034	1,000,000	1,035,310	0.06%
CITIGROUP INC S+0.87% Q 04MAR2029	738,000	739,875	0.04%
CITIGROUP INC S+1.171% Q 11SEP2031	2,900,000	2,923,113	0.16%
CVS HEALTH CORP 5.45% S/A 15SEP2035	1,000,000	1,012,160	0.06%
CVS HEALTH CORP 7% S/A 10MAR2055	500,000	518,945	0.03%
DAIMLER FINANCE NORTH AMERICA LLC 4.95% S/A 13JAN2028	1,800,000	1,809,324	0.10%
DAIMLER FINANCE NORTH AMERICA LLC 5.25% S/A 13JAN2030	6,000,000	6,071,100	0.34%
DAIMLER FINANCE NORTH AMERICA LLC S+0.96% Q 25SEP2027	550,000	551,260	0.03%
DAIMLER TRUCK FINANCE NORTH AMERICA LLC 5.375% S/A 13JAN2032	5,500,000	5,568,915	0.31%
DEERE & CO 5.45% S/A 16JAN2035	700,000	723,513	0.04%
DTE ENERGY CO 5.2% S/A 01APR2030	3,500,000	3,549,000	0.20%
DUKE ENERGY CORP 6.45% S/A 01SEP2054	300,000	311,199	0.02%
EIDP INC 5.125% S/A 15MAY2032	900,000	908,829	0.05%
ELI LILLY & CO 4.75% S/A 12FEB2030	1,600,000	1,616,656	0.09%
ELI LILLY & CO 4.9% S/A 12FEB2032	1,500,000	1,519,515	0.09%
ELI LILLY & CO 5.1% S/A 12FEB2035	1,000,000	1,014,730	0.06%
ENERGY TRANSFER LP 5.2% S/A 01APR2030	500,000	507,610	0.03%
ENERGY TRANSFER LP 6.5% S/A 15FEB2056	900,000	907,875	0.05%
ENTERPRISE PRODUCTS OPERATING LLC 5.2% S/A 15JAN2036	500,000	501,085	0.03%
EOG RESOURCES INC 5% S/A 15JUL2032	1,800,000	1,811,376	0.10%
FORD MOTOR CREDIT CO LLC 5.875% S/A 07NOV2029	2,000,000	2,022,840	0.11%
GENERAL MOTORS CO 5.35% S/A 15APR2028	1,100,000	1,110,956	0.06%
GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 4.9% S/A 06OCT2029	500,000	500,945	0.03%
GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 5.35% S/A 07JAN2030	1,000,000	1,015,450	0.06%
GLENCORE FUNDING LLC 4.907% S/A 01APR2028 REGS	500,000	502,310	0.03%
GLENCORE FUNDING LLC 5.186% S/A 01APR2030 REGS	250,000	252,518	0.01%
GLENCORE FUNDING LLC 5.673% S/A 01APR2035 REGS	1,500,000	1,536,135	0.09%
GOLDMAN SACHS GROUP INC 5.207% S/A 28JAN2031	1,500,000	1,514,895	0.09%
GOLDMAN SACHS GROUP INC 5.536% S/A 28JAN2036	2,400,000	2,434,920	0.14%
GOODMAN US FINANCE FIVE LLC 4.625% S/A 04MAY2032 REGS	1,000,000	972,230	0.05%
GOODMAN US FINANCE SEVEN LLC 5.25% S/A 28APR2036	600,000	588,636	0.03%

华夏精选固定收益配置基金

（华夏精选基金的子基金）

投资组合列表（未审计）（续）

2026年6月30日

未上市/挂牌投资	名义数量	公允价值 美元	在资产净值 中的占比
<u>债务证券（续）</u>			
美国（续）			
GOODMAN US FINANCE SIX LLC 5.125% S/A 07OCT2034 REGS	2,500,000	2,460,325	0.14%
HERSHEY CO 4.55% S/A 24FEB2028	1,000,000	1,003,390	0.06%
HERSHEY CO 4.75% S/A 24FEB2030	1,000,000	1,008,520	0.06%
HP INC 5.4% S/A 25APR2030	2,000,000	2,036,480	0.11%
HP INC 6.1% S/A 25APR2035	1,300,000	1,361,009	0.08%
HSBC USA INC 3M S+0.97% Q 03JUN2028	1,500,000	1,510,170	0.09%
HYATT HOTELS CORP 5.05% S/A 30MAR2028	1,000,000	1,006,000	0.06%
HYATT HOTELS CORP 5.75% S/A 30MAR2032	1,000,000	1,029,770	0.06%
HYUNDAI CAPITAL AMERICA 4.9% S/A 23 JUN 2028 REGS	2,000,000	2,006,280	0.11%
HYUNDAI CAPITAL AMERICA 5.1% S/A 24JUN2030 REGS	1,500,000	1,505,940	0.08%
HYUNDAI CAPITAL AMERICA 5.4% S/A 23JUN2032 REGS	1,000,000	1,014,220	0.06%
HYUNDAI CAPITAL AMERICA S+0.89% Q 08JAN2029	800,000	800,056	0.05%
HYUNDAI CAPITAL AMERICA S+1.07% Q 08JAN2031	800,000	800,016	0.05%
HYUNDAI CAPITAL AMERICA S+1.30% Q 18SEP2030	5,300,000	5,360,473	0.30%
JACKSON NATIONAL LIFE GLOBAL FUNDING 5.35% S/A 13JAN2030	5,000,000	5,044,750	0.28%
JOHN DEERE CAPITAL CORP 4.65% S/A 07JAN2028	2,000,000	2,010,840	0.11%
JOHNSON & JOHNSON S/A 4.5% 01MAR2027	1,000,000	1,002,710	0.06%
JOHNSON & JOHNSON S/A 4.55% 01MAR2028	2,000,000	2,011,120	0.11%
JPMORGAN CHASE & CO 4.505% S/A 22OCTFEB2028	1,000,000	999,330	0.06%
JPMORGAN CHASE & CO 4.979% S/A 22JUL2028	500,000	501,970	0.03%
JPMORGAN CHASE & CO 5.012% S/A 23JAN2030	400,000	402,400	0.02%
JPMORGAN CHASE & CO 5.103% S/A 22APR2031	800,000	808,768	0.05%
JPMORGAN CHASE & CO 5.14% S/A 24JAN2031	1,000,000	1,010,960	0.06%
JPMORGAN CHASE & CO 5.502% S/A 24JAN2036	2,000,000	2,042,080	0.12%
JPMORGAN CHASE & CO 5.572% S/A 22APR2036	800,000	821,272	0.05%
JPMORGAN CHASE & CO S+0.8% Q 24JAN2029	1,000,000	1,002,980	0.06%
JPMORGAN CHASE & CO S+0.86% Q 22OCT2028	2,000,000	2,007,800	0.11%
JPMORGAN CHASE BANK 5.8% A 23JAN2035	5,000,000	5,000,000	0.28%
JPMORGAN CHASE BK NA 5.7% A 20FEB2035	5,000,000	5,000,000	0.28%
JPMORGAN CHASE BK NA 5.8% A 20FEB2035	5,000,000	5,000,000	0.28%
KINDER MORGAN INC 5.15% S/A 01JUN2030	500,000	508,020	0.03%
KINDER MORGAN INC 5.85% S/A 01JUN2035	250,000	260,798	0.01%
KRAFT HEINZ FOODS CO 5.2% S/A 15MAR2032	500,000	506,035	0.03%
MCKESSON CORP 4.95% S/A 30MAY2032	1,700,000	1,710,315	0.10%
MCKESSON CORP 5.25% S/A 30MAY2035	2,100,000	2,132,529	0.12%
MERCK & CO INC 4.95% S/A 22MAY2033	400,000	402,240	0.02%

华夏精选固定收益配置基金

（华夏精选基金的子基金）

投资组合列表（未审计）（续）

2026年6月30日

未上市/挂牌投资	名义数量	公允价值 美元	在资产净值 中的占比
<u>债务证券（续）</u>			
美国（续）			
MERRILL LYNCH BV 5.55% A 12MAY2036	5,000,000	5,000,000	0.28%
MERRILL LYNCH BV 5.6% A 26JUN2035	5,000,000	5,000,000	0.28%
METLIFE INC 6.35% S/A 15MAR2055	1,500,000	1,537,365	0.09%
MICRON TECHNOLOGY INC 5.8% S/A 15JAN2035	300,000	313,902	0.02%
MORGAN STANLEY 4.994% S/A 12APR2029	800,000	804,072	0.05%
MORGAN STANLEY BANK NA 4.788% S/A 10MAY2030	3,000,000	2,999,970	0.17%
NEXTERA ENERGY CAPITAL HLDGS INC 4.8% S/A 01DEC2077	4,000,000	3,951,640	0.22%
O'REILLY AUTOMOTIVE INC 5.75% S/A 20NOV2026	200,000	200,772	0.01%
PACIFICORP 7.375% S/A 15SEP2055	500,000	505,035	0.03%
PAYCHEX INC 5.35% S/A 15APR2032	400,000	404,416	0.02%
QUALCOMM INC 4.5% S/A 20MAY2030	2,000,000	1,997,940	0.11%
QUALCOMM INC 5% S/A 20MAY2035	1,000,000	995,080	0.06%
RALPH LAUREN CORP 5% S/A 15JUN2032	1,000,000	1,009,590	0.06%
RANDE PROPERTY 6.65% S/A 01JUN2055	600,000	614,322	0.03%
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC 5.25% S/A 09JAN2030	1,500,000	1,519,290	0.09%
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC 6.65% S/A 15SEP2055	400,000	405,928	0.02%
RYDER SYSTEM INC 4.85% S/A 15JUN2030	250,000	250,818	0.01%
SYSCO CORP 5.1% S/A 23SEP2030	750,000	756,518	0.04%
T-MOBILE USA INC 5.125% S/A 15MAY2032	1,800,000	1,816,830	0.10%
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 4.5% S/A 14MAY2027	2,000,000	2,004,640	0.11%
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 4.8% S/A 15MAY2030	500,000	502,770	0.03%
UNITED PARCEL SERVICE INC 5.25% S/A 14MAY2035	1,000,000	1,019,150	0.06%
UNITEDHEALTH GROUP INC 5.3% S/A 15JUN2035	250,000	254,280	0.01%
VIRGINIA ELECTRIC AND POWER CO 6% S/A 15FEB2056	1,500,000	1,505,355	0.08%
VOLKSWAGEN GROUP OF AMERICA FINANCE LLC 6% S/A 16NOV2026 REGS	750,000	754,095	0.04%
WALMART INC 4.9% S/A 28APR2035	2,500,000	2,518,700	0.14%
WASTE CONNECTIONS INC 5.25% S/A 01SEP2035	300,000	303,750	0.02%
WELLS FARGO & CO 5.244% S/A 24JAN2031	500,000	506,565	0.03%
WELLS FARGO & CO S+0.78% Q 24JAN2028	1,500,000	1,502,235	0.08%
WELLS FARGO FINANCE LLC 5.6% A 26JUN2035	5,000,000	5,000,000	0.28%
WELLS FARGO FINANCE LLC 5.7% A 22NOV2034	5,000,000	5,000,000	0.28%
WELLS FARGO FINANCE LLC 5.8% A 19FEB2035	5,000,000	5,000,000	0.28%
WISCONSIN POWER AND LIGHT CO 5.95% S/A 30MAR2029	300,000	308,556	0.02%
		192,291,638	10.83%

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合列表(未审计)(续)

2026年6月30日

互惠基金/单位信托	名义数量	公允价值 美元	在资产净值 中的占比
中国香港			
CHINAAMC CHOICE FUND - CHINAAMC CHOICE OFFSHORE RMB BOND FUND	1,100,000	11,072,710	0.62%
CHINAAMC GLOBAL INVESTMENT GRADE BOND FUND-I DIS USD A	7,669,101	96,661,354	5.45%
CHINAAMC SELECT ASIA BOND FUND-I ACC USD	7,408,986	73,326,737	4.14%
CHINAAMC SELECT OFFSHORE RMB INCOME BOND FUND I USD HEDGED ACC	450,000	4,631,940	0.26%
CHINAAMC SELECT RMB INVESTMENT GRADE INCOME FUND-I USD HEDGED ACC	18,009,128	212,334,821	11.98%
		398,027,562	22.45%
卢森堡			
CHINAAMC GLOBAL SELECTED INCOME FUND-I A USD	1,105,879	13,509,414	0.76%
		13,509,414	0.76%

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合列表 (未审计) (续)

2026年6月30日

	公允价值 美元	在资产净值 中的占比
远期外汇合约		
Buy RMB 5,584,553,512 Sell USD 831,690,695	(3,653,489)	-0.21%
Buy AUD 1,890,000 Sell USD 1,342,180	(42,675)	0.00%
Buy USD 29,425,742 Sell RMB 200,000,000	(32,109)	0.00%
Buy RMB 40,000,000 Sell USD 5,922,168	(25,312)	0.00%
Buy RMB 70,000,000 Sell USD 10,334,463	(14,964)	0.00%
Buy EUR 490,800 Sell USD 572,585	(11,586)	0.00%
Buy EUR 612,000 Sell USD 705,571	(7,302)	0.00%
Buy RMB 7,400,000 Sell USD 1,094,934	(4,015)	0.00%
Buy RMB 5,000,000 Sell USD 739,528	(2,421)	0.00%
Buy RMB 3,000,000 Sell USD 443,363	(1,098)	0.00%
Buy RMB 2,000,000 Sell USD 295,497	(654)	0.00%
Buy USD 690 Sell AUD 1,000	1	0.00%
Buy USD 415,475 Sell AUD 599,000	3,207	0.00%
Buy USD 1,893,823 Sell RMB 12,800,000	6,827	0.00%
Buy USD 495,804 Sell AUD 706,000	9,491	0.00%
Buy USD 423,466 Sell AUD 597,000	12,987	0.00%
Buy RMB 50,000,000 Sell USD 7,397,872	15,759	0.00%
Buy USD 1,186,576 Sell AUD 1,690,000	22,456	0.00%
Buy USD 13,440,316 Sell RMB 91,000,000	24,953	0.00%
Buy USD 1,501,094 Sell AUD 2,120,000	40,777	0.00%
Buy USD 2,036,513 Sell AUD 2,892,000	46,067	0.00%
Buy USD 1,348,558 Sell AUD 1,890,000	49,053	0.00%
Buy USD 2,040,255 Sell AUD 2,891,000	50,497	0.00%

华夏精选固定收益配置基金

(华夏精选基金的子基金)

投资组合列表 (未审计) (续)

2026年6月30日

	公允价值 美元	在资产净值 中的占比
远期外汇合约 (续)		
Buy USD 1,776,561 Sell EUR 1,500,000	57,201	0.00%
Buy USD 4,055,040 Sell AUD 5,797,000	65,200	0.00%
Buy USD 2,154,164 Sell EUR 1,825,000	72,082	0.00%
Buy USD 63,465,169 Sell RMB 430,000,000	73,892	0.00%
Buy USD 2,166,478 Sell AUD 3,000,000	100,035	0.01%
Buy USD 4,114,569 Sell AUD 5,745,000	160,518	0.01%
投资组合合计	1,727,763,681	97.45%
其他资产	45,204,174	2.55%
净资产总额	1,772,967,855	100.00%
投资成本总额	1,694,010,034	

华夏精选固定收益配置基金

（华夏精选基金的子基金）

派息披露（未审计）

自2026年1月1日至2026年6月30日

美元

于 2025 年 12 月 31 日的未分配收入	-
本年度利润及全面收益总额	34,004,777
加：财务费用——向基金份额持有人所作收益分配	1,309,083
收益分配前的未分配收入	35,313,860

2026 年 1 月 30 日支付的收益分配（已于 2026 年 1 月 19 日记录）

A 类（港币派息）每份额 0.0434 港币	(11)
A 类（人民币派息）每份额人民币 0.0249 元	(8)
A 类（人民币派息）（对冲）每份额人民币 0.0249 元	(8)
A 类（美元派息）每份额 0.0434 美元	(87)
I 类（美元派息）每份额 0.051 美元	(255,217)

2026 年 2 月 27 日支付的收益分配（已于 2026 年 2 月 12 日记录）

A 类（港币派息）每份额 0.0435 港币	(11)
A 类（人民币派息）每份额人民币 0.0247 元	(7)
A 类（人民币派息）（对冲）每份额人民币 0.0247 元	(7)
A 类（美元派息）每份额 0.0434 美元	(86)
I 类（美元派息）每份额 0.051 美元	(255,217)

2026 年 3 月 31 日支付的收益分配（已于 2026 年 3 月 18 日记录）

A 类（港币派息）每份额 0.0433 港币	(1,069)
A 类（人民币派息）每份额人民币 0.0245 元	(7)
A 类（人民币派息）（对冲）每份额人民币 0.0245 元	(7)
A 类（美元派息）每份额 0.043 美元	(86)
I 类（美元派息）每份额 0.0506 美元	(253,765)

2026 年 4 月 30 日支付的收益分配（已于 2026 年 4 月 17 日记录）

A 类（港币派息）每份额 0.0433 港币	(1,069)
A 类（人民币派息）每份额人民币 0.0244 元	(7)
A 类（人民币派息）（对冲）每份额人民币 0.0244 元	(7)
A 类（美元派息）每份额 0.0431 美元	(86)
I 类（美元派息）每份额 0.0507 美元	(174,961)

2026 年 5 月 29 日支付的收益分配（已于 2026 年 5 月 15 日记录）

A 类（港币派息）每份额 0.0431 港币	(5,319)
A 类（人民币派息）每份额人民币 0.0242 元	(7)
A 类（人民币派息）（对冲）每份额人民币 0.0242 元	(7)
A 类（美元派息）每份额 0.0428 美元	(4,236)
I 类（美元派息）每份额 0.0504 美元	(173,926)

华夏精选固定收益配置基金

（华夏精选基金的子基金）

派息披露（未审计）（续）

自2026年1月1日至2026年6月30日

美元

2026年6月30日支付的收益分配（已于2026年6月16日记录）

A类（港币派息）每份额0.0431港币 (5,316)

A类（人民币派息）每份额人民币0.0241元 (7)

A类（人民币派息）（对冲）每份额人民币0.0241元 (7)

A类（美元派息）每份额0.0429美元 (4,264)

I类（美元派息）每份额0.0505美元 (174,271)

转入资本 (34,004,777)

于2026年6月30日的未分配收入 -

基金管理人可全权酌情决定在每个财务期间的确定时间将收益派发给基金份额持有人，或在任意财务期间不做任何派发。向基金份额持有人派发的款项（如有）将来源于本子基金的资金/总收入。

2026年1月1日至2026年6月30日期间，本子基金派发股息总额为1,309,083美元；2025年1月1日至2025年6月30日期间，本子基金未派发任何股息。



华夏基金(香港)有限公司
CHINA ASSET MANAGEMENT (HONG KONG) LIMITED

www.ChinaAMC.com.hk

香港中环花园道1号中银大厦37楼

客服热线: (852) 3406 8686