

华夏安康稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：二〇二六年八月三十一日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	16
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	16
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 净资产变动表	19
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	38
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	39
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	39
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	39
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	39
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	39
7.12 本报告期投资基金情况	40
7.13 投资组合报告附注	43

§8 基金份额持有人信息	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	44
8.2 盈利投资者数量占比	44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	44
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	45
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况	45
§9 开放式基金份额变动	45
§10 重大事件揭示	45
10.1 基金份额持有人大会决议	45
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	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	46
10.4 基金投资策略的改变	46
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	46
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	46
10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	46
10.8 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	46
10.9 其他重大事件	48
§11 影响投资者决策的其他重要信息	48
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	48
§12 备查文件目录	48
12.1 备查文件目录	48
12.2 存放地点	49
12.3 查阅方式	49

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏安康稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）	
基金简称	华夏安康稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）	
基金主代码	013158	
交易代码	013158	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 3 月 15 日	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	148,478,185.11 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华夏安康稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）A	华夏安康稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）Y
下属分级基金的交易代码	013158	017356
报告期末下属分级基金的份额总额	103,512,143.14 份	44,966,041.97 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险的前提下，通过资产配置、基金优选，力求基金资产稳定增值。
投资策略	主要投资策略包括资产配置策略、基金投资策略、股票投资策略、固定收益品种投资策略等。在资产配置策略上，本基金采用目标风险策略，为稳健目标风险型基金。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×25%+中债综合（全价）指数收益率×75%
风险收益特征	本基金属于混合型基金中基金（FOF），是目标风险型基金，目标风险按照风险水平由低至高分为保守、稳健、均衡、积极、进取，本产品为稳健目标风险。其长期平均风险和预期收益率低于股票基金，高于货币市场基金和债券基金。本基金还可通过港股通渠道投资于香港证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还将面临汇率风险、香港市场风险等特殊投资风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华夏基金管理有限公司	招商银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	李彬	张姗
	联系电话	400-818-6666	400-61-95555
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-818-6666	400-61-95555
传真		010-63136700	0755-83195201
注册地址		北京市顺义区安庆大街甲3号院	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		北京市朝阳区北辰西路6号院北辰中心C座5层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		100101	518040
法定代表人		邹迎光	缪建民

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.ChinaAMC.com
基金中期报告置备地点	基金管理人和/或基金托管人的住所/办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华夏基金管理有限公司	北京市朝阳区北辰西路 6 号院北辰中心 C 座 5 层

§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）	
	华夏安康稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）A	华夏安康稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）Y
本期已实现收益	57,061.89	-83,619.23
本期利润	963,639.53	423,638.76
加权平均基金份额本期利润	0.0077	0.0090
本期加权平均净值利润率	0.69%	0.81%
本期基金份额净值增长率	0.69%	0.78%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026年6月30日）	

	华夏安康稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）A	华夏安康稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）Y
期末可供分配利润	7,972,164.14	4,166,713.48
期末可供分配基金份额利润	0.0770	0.0927
期末基金资产净值	115,073,037.62	50,522,281.66
期末基金份额净值	1.1117	1.1236
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026年6月30日）	
	华夏安康稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）A	华夏安康稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）Y
基金份额累计净值增长率	11.17%	12.36%

注：①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。

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

③期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

④本基金 T 日的基金份额净值在 T+3 日内公告。

⑤本基金自 2022 年 11 月 16 日增加 Y 类基金份额类别。

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

华夏安康稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）A：

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	2.16%	0.32%	3.42%	0.32%	-1.26%	0.00%
过去六个月	0.69%	0.32%	2.67%	0.29%	-1.98%	0.03%
过去一年	3.58%	0.26%	5.87%	0.25%	-2.29%	0.01%
过去三年	11.50%	0.25%	11.74%	0.27%	-0.24%	-0.02%
自基金合同生效起至今	11.17%	0.25%	11.14%	0.27%	0.03%	-0.02%

华夏安康稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）Y：

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

过去三个月	2.20%	0.32%	3.42%	0.32%	-1.22%	0.00%
过去六个月	0.78%	0.32%	2.67%	0.29%	-1.89%	0.03%
过去一年	3.78%	0.26%	5.87%	0.25%	-2.09%	0.01%
过去三年	12.21%	0.25%	11.74%	0.27%	0.47%	-0.02%
自新增份额类别以来至今	12.36%	0.25%	13.32%	0.26%	-0.96%	-0.01%

注：①本基金自 2022 年 11 月 16 日增加 Y 类基金份额类别。

②2022 年 11 月 16 日至 2022 年 11 月 22 日期间，华夏安康稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）Y 类基金份额为零。

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

华夏安康稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2022 年 3 月 15 日至 2026 年 6 月 30 日）

华夏安康稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）A：



华夏安康稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）Y：

排名第 2/307、华夏兴源稳健一年持有混合 A 排名第 17/307、华夏永顺一年持有混合 A 排名第 31/307；在短期纯债债券型基金(A 类)中，华夏安益短债债券 A 排名第 7/133、华夏 30 天滚动短债债券发起式 A 排名第 8/133；在利率债纯债债券型基金(A 类)中，华夏鼎昭利率债债券 A 排名第 7/98；在普通债券型基金(二级)(A 类)中，华夏鼎沛债券 A 排名第 10/540、华夏鼎清债券 A 排名第 12/540、华夏鼎利债券 A 排名第 47/540；在普通偏债型基金(股票上限高于 30%)(A 类)中，华夏永鑫六个月持有混合 A 排名第 17/245、华夏永泓一年持有混合 A 排名第 28/245；在长期纯债债券型基金(A 类)中，华夏鼎富债券 A 排名第 61/1041、华夏鼎航债券 A 排名第 67/1041、华夏鼎信债券 A 排名第 115/1041、华夏纯债债券 A 排名第 234/1041、华夏鼎茂债券 A 排名第 268/1041；在标准偏债型基金(股票上下限 10%-30%)(A 类)中，华夏稳进增益一年持有混合 A 排名第 11/71。

在客户服务方面，2026 年上半年，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户使用的便利性和服务体验：（1）华夏基金管家客户端优化基金详情展示，增强信息可读性，从客户投资需求出发，进一步提升使用体验；（2）与国贸期货、新华信通等代销机构合作，拓展更加丰富的客户理财渠道；（3）开展“未来，我们继续一起走过”、“选择难度大？给你支个招”、“当前科技股的三国博弈”等活动，为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 （助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李晓易	本基金的基金经理	2022-05-24	-	11 年	硕士。曾任中信期货有限公司资产管理部研究员、投资经理。2015 年 4 月加入华夏基金管理有限公司。历任资产配置部研究员、华夏聚惠稳健目标风险混合型基金中基金（FOF）基金经理（2019 年 1 月 24 日至 2022 年 5 月 24 日期

					间)、华夏养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金经理 (2022 年 5 月 24 日至 2024 年 6 月 11 日期间)、华夏博锐一年持有期混合型管理人中管理人 (MOM) 发起式证券投资基金基金经理 (2022 年 5 月 24 日至 2024 年 9 月 23 日期间)、华夏均衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金经理 (2022 年 5 月 24 日至 2025 年 5 月 26 日期间) 等。
孟清扬	本基金的基金经理助理	2022-04-28	-	8 年	博士。2018 年 7 月加入华夏基金管理有限公司。历任资产配置部研究员、基金经理助理。

注：①上述“任职日期”和“离任日期”为根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。首任基金经理的，其“任职日期”为基金合同生效日。

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 中期报告财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华夏安康稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	6,378,983.21	6,067,744.31
结算备付金		91,082.74	458,815.48
存出保证金		36,459.02	24,052.45
交易性金融资产	6.4.7.2	160,038,815.98	221,093,186.47
其中：股票投资		-	-
基金投资		150,944,385.02	209,679,096.72
债券投资		9,094,430.96	11,414,089.75
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-

买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	1,995,798.73
应收股利		-	-
应收申购款		237,056.02	580,626.78
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		166,782,396.97	230,220,224.22
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		-	7,048,230.87
应付赎回款		1,037,992.06	713,727.37
应付管理人报酬		26,529.25	42,773.76
应付托管费		13,500.69	17,912.88
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		332.98	0.42
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	108,722.71	152,900.00
负债合计		1,187,077.69	7,975,545.30
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	148,478,185.11	200,808,070.71
未分配利润	6.4.7.8	17,117,134.17	21,436,608.21
净资产合计		165,595,319.28	222,244,678.92
负债和净资产总计		166,782,396.97	230,220,224.22

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，华夏安康稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）A 基金份额净值 1.1117 元，华夏安康稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）Y 基金份额净值 1.1236 元；华夏安康稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）基金份额总额 148,478,185.11 份（其中 A 类 103,512,143.14 份，Y 类 44,966,041.97 份）。

6.2 利润表

会计主体：华夏安康稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

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		1,791,124.48	3,564,841.44
1.利息收入		6,672.44	12,137.51
其中：存款利息收入	6.4.7.9	6,079.62	7,399.78
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		592.82	4,737.73
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		370,616.41	388,391.10
其中：股票投资收益	6.4.7.1 0	-	-
基金投资收益	6.4.7.1 1	295,180.86	181,375.07
债券投资收益	6.4.7.1 2	65,866.99	63,545.75
资产支持证券投资收益	6.4.7.1 3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.1 4	-	-
衍生工具收益	6.4.7.1 5	-	-
股利收益	6.4.7.1 6	9,568.56	143,470.28
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 7	1,413,835.63	3,163,349.29

4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 8	-	963.54
减：二、营业总支出		403,846.19	458,922.93
1.管理人报酬		215,640.77	276,235.72
2.托管费		95,351.22	96,310.60
3.销售服务费		-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失	6.4.7.2 0	-	-
7.税金及附加		4,984.31	3,384.35
8.其他费用	6.4.7.2 1	87,869.89	82,992.26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,387,278.29	3,105,918.51
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,387,278.29	3,105,918.51
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,387,278.29	3,105,918.51

6.3 净资产变动表

会计主体：华夏安康稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

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	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	200,808,070.71	21,436,608.21	222,244,678.92
二、本期期初净资产	200,808,070.71	21,436,608.21	222,244,678.92
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-52,329,885.60	-4,319,474.04	-56,649,359.64
（一）、综合收益总额	-	1,387,278.29	1,387,278.29

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	6,378,983.21
等于：本金	6,378,337.50
加：应计利息	645.71
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	-
合计	6,378,983.21

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		-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	9,009,013.00	88,130.96	9,094,430.96	-2,713.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	9,009,013.00	88,130.96	9,094,430.96	-2,713.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		146,470,964.01	-	150,944,385.02	4,473,421.01
其他		-	-	-	-

合计	155,479,977.01	88,130.96	160,038,815.98	4,470,708.01
----	----------------	-----------	----------------	--------------

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

无。

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

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	108,722.71
合计	108,722.71

6.4.7.7 实收基金

华夏安康稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）A

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	151,385,842.83	151,385,842.83

本期基金份额交易产生的变动数	-437,846.78	-106,252.13	-544,098.91
其中：基金申购款	478,668.85	104,532.12	583,200.97
基金赎回款	-916,515.63	-210,784.25	-1,127,299.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,166,713.48	1,389,526.21	5,556,239.69

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	5,535.76
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	463.78
其他	80.08
合计	6,079.62

6.4.7.10 股票投资收益

无。

6.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	219,301,825.30
减：卖出/赎回基金成本总额	218,954,764.56
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	40,723.36
减：交易费用	11,156.52
基金投资收益	295,180.86

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 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	67,990.99

债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-2,124.00
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	65,866.99

6.4.7.12.2 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	11,451,045.57
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	11,301,565.00
减：应计利息总额	151,604.57
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-2,124.00

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.16 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	-
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	9,568.56
合计	9,568.56

6.4.7.17 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	1,413,835.63
——股票投资	-
——债券投资	-4,538.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	1,418,373.63
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	1,413,835.63

6.4.7.18 其他收入

无。

6.4.7.19 持有基金产生的费用

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	3,510.55
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	420,389.55
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	92,838.02

注：上述费用为根据所投资基金的招募说明书列明的计算方法对销售服务费、管理费和托管费进行的估算；上述费用已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用项目。

6.4.7.20 信用减值损失

无。

6.4.7.21 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	16,315.34

信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	3,047.18
银行间账户维护费	9,000.00
合计	87,869.89

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无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

本基金本报告期不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。

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
华夏基金管理有限公司	基金管理人
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人

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

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 基金交易

无。

	其中：股票	-	-
2	基金投资	150,944,385.02	90.50
3	固定收益投资	9,094,430.96	5.45
	其中：债券	9,094,430.96	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	-	-
	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	6,470,065.95	3.88
8	其他各项资产	273,515.04	0.16
9	合计	166,782,396.97	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未进行股票买入。

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

本基金本报告期末未进行股票卖出。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未进行股票交易。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	9,094,430.96	5.49
2	央行票据	-	-

35	009082	华夏鼎佳债券 A	契约型开放式	0.96	1.11	0.00	是
35	004979	华夏鼎诺三个月定期开放债券 A	契约型开放式	0.99	1.11	0.00	是
37	005791	华夏鼎福三个月定期开放债券 A	契约型开放式	1.02	1.08	0.00	是
37	004923	华夏鼎祥三个月定期开放债券 A	契约型开放式	1.08	1.08	0.00	是

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.13.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。

7.13.3 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	36,459.02
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	237,056.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	273,515.04

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5、基金管理人业务资格批件、营业执照；

6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司

二〇二六年八月三十一日