

华宝新活力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：中国民生银行股份有限公司

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。

基金托管人中国民生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	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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 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所有股票投资明细	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	52

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	52
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	52
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	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 投资组合报告附注	53
§ 8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 盈利投资者数量占比	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
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	55
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
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	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	56
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	56
10.8 其他重大事件	57
§ 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	58
§ 12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	58
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	华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	华宝新活力混合	
基金主代码	003154	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 9 月 7 日	
基金管理人	华宝基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	28,035,884.18 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华宝新活力混合 C	华宝新活力混合 I
下属分级基金的交易代码	003154	024065
报告期末下属分级基金的份额总额	22,379,481.60 份	5,656,402.58 份

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，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	沪深 300 指数收益率×50% + 上证国债指数收益率×50%
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	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周雷	林盛
	联系电话	021-38505888	010-58560666
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	tgxxpl@cmbc.com.cn
客户服务电话		400-700-5588、400-820-5050	95568
传真		021-38505777	010-57093382
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 2 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 2 号

邮政编码	200120	100031
法定代表人	夏雪松	高迎欣

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
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办公场所。

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)	
	华宝新活力混合 C	华宝新活力混合 I
本期已实现收益	2,635,139.81	46,133.27
本期利润	3,937,074.94	14,499.22
加权平均基金份 额本期利润	0.1663	0.0031
本期加权平均净 值利润率	7.72%	0.14%
本期基金份额净 值增长率	7.80%	1.74%
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	26,524,103.64	6,718,096.64
期末可供分配基 金份额利润	1.1852	1.1877
期末基金资产净 值	48,903,585.24	12,374,499.22
期末基金份额净 值	2.1852	2.1877
3.1.3 累计期	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	

末指标		
基金份额累计净值增长率	127.74%	1.74%

- 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

华宝新活力混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	7.52%	1.18%	6.43%	0.63%	1.09%	0.55%
过去六个月	7.80%	1.38%	4.74%	0.57%	3.06%	0.81%
过去一年	26.75%	1.11%	13.51%	0.51%	13.24%	0.60%
过去三年	38.52%	0.74%	22.20%	0.55%	16.32%	0.19%
过去五年	39.36%	0.58%	10.02%	0.55%	29.34%	0.03%
过去七年	82.48%	0.51%	34.86%	0.58%	47.62%	-0.07%
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	127.74%	0.57%	52.17%	0.57%	75.57%	0.00%

华宝新活力混合 I

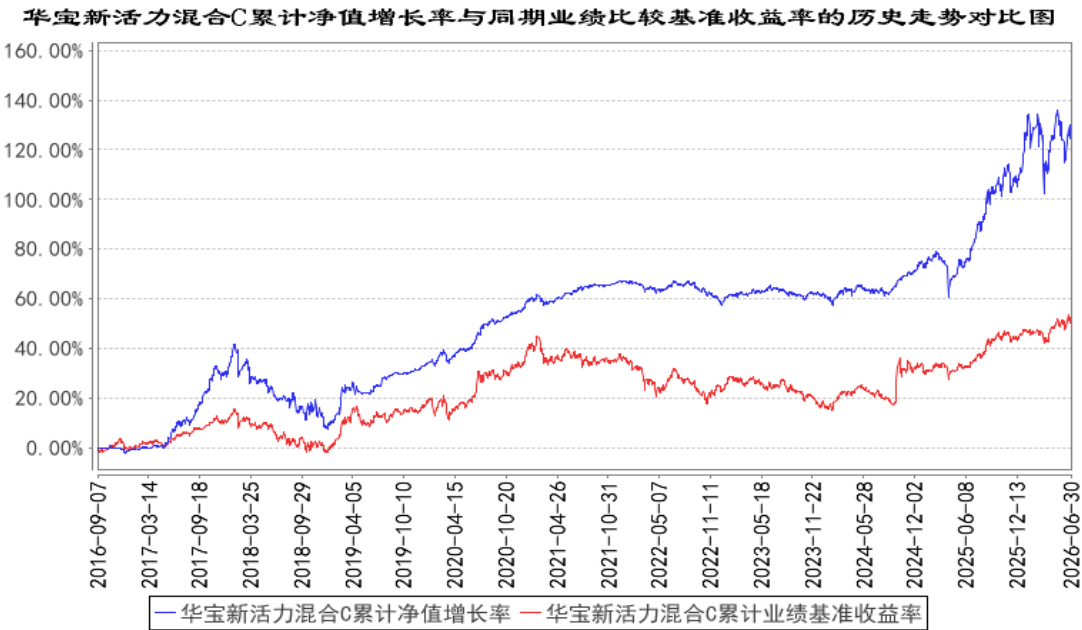
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	7.58%	1.18%	6.43%	0.63%	1.15%	0.55%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-

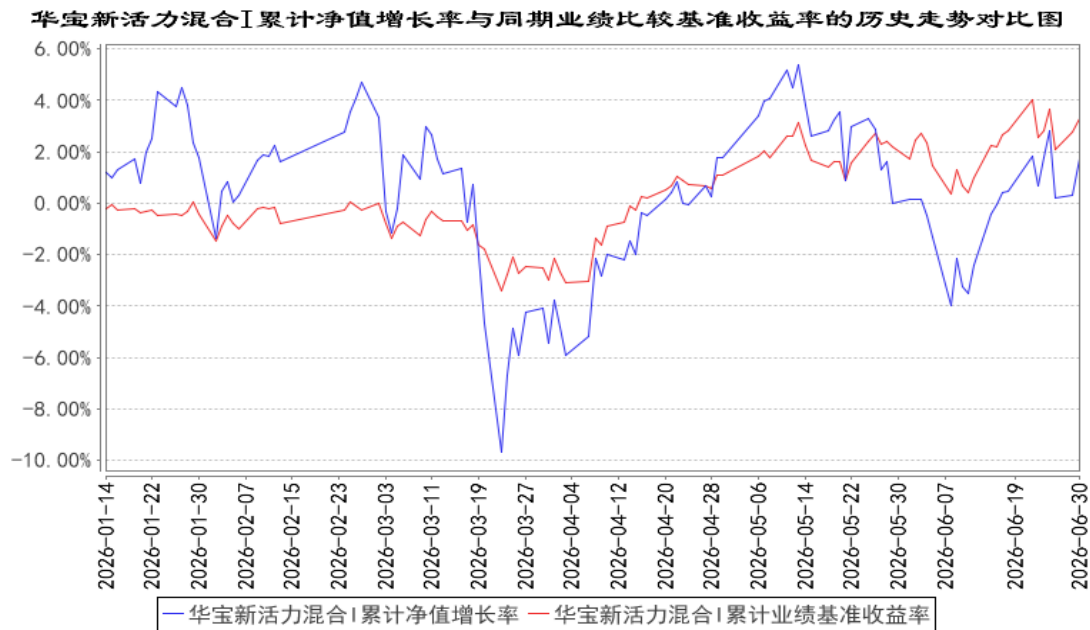
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同 生效起至今	1.74%	1.39%	3.27%	0.57%	-1.53%	0.82%

注：（1）基金业绩基准：沪深 300 指数收益率×50% + 上证国债指数收益率×50%；

（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 2017 年 03 月 07 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		
姜松尚	本基金基金经理	2025-12-31	-	5 年	硕士。曾在兴银基金管理有限责任公司从事投研工作。2025 年 10 月加入华宝基金管理有限公司，任指数研发投资部指数资深分析师。2025 年 12 月起任华宝中证 500

					指数增强型发起式证券投资基金、华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金、华宝科技先锋混合型证券投资基金基金经理。
喻银尤	本基金基金经理	2025-03-29	2026-04-10	10 年	硕士。曾在中信建投证券股份有限公司从事量化研究工作，2018 年 9 月加入华宝基金管理有限公司，历任量化分析师、投资经理等职务。2022 年 7 月至 2026 年 1 月任华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理，2023 年 2 月起任华宝量化选股混合型发起式证券投资基金基金经理，2025 年 3 月至 2026 年 4 月任华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2025 年 6 月起任华宝中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理，2025 年 9 月起任华宝上证科创板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金联接基金（原：华宝上证科创板综合指数增强型证券投资基金）基金经理，2026 年 3 月起任华宝价值发现混合型证券投资基金基金经理，2026 年 5 月起任华宝上证科创板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
唐雪倩	本基金的基金经理助理	2019-07-12	-	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、基金经理助理等职务。2018 年 1 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助理，2018 年 1 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助理，2018 年 1 月至 2018 年 8 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助理，2019 年 2 月至 2022 年 8 月起任华宝科技先锋混合型证券投资基金基金经理助理，2021 年 8 月至 2021 年 10 月任华宝安享混合型证券投资基金基金经理助理，2021 年 9 月至 2021 年 10 月任华宝安益混合型证券投资基金基金经理助理，2018 年 1 月至 2023 年 4 月任华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金、华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理助理，2018 年 1 月至 2023 年 8 月任华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理，2018 年 1 月至 2023 年 9 月任华宝新飞跃灵活

					配置混合型证券投资基金基金经理助理，2018 年 1 月至 2024 年 6 月任华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理，2019 年 7 月起任华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。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遵规守信情况的说明

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、《华宝新活力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 A 股市场呈现显著的结构分化特征。三大指数全线收涨，上证指数上涨 3.16% 站上 4000 点。在科技成长风格带动下，市场成交活跃，AI 硬科技全产业链（半导体设备、光模块、芯片等）成为主线。消费、红利等板块则相对表现平淡，市场个股分化明显。本基金采用量化方法持续挖掘优质个股，采用较严格的风险控制策略，不押注特定风格与行业，追求稳健超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额 C 类净值增长率为 7.80%; 同期业绩比较基准收益率为 4.74%。本报告期基金份额 I 类净值增长率为 1.74%; 同期业绩比较基准收益率为 3.27%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济方面，全球经济呈现“K 型分化”，地缘冲突推升通胀中枢，美联储加息预期将是市场未来博弈关键，若美联储降息路径在三季度逐步明朗，全球风险偏好回暖将为 A 股提供外部支撑。国内经济新旧动能转换势头不变，政策上或将保持适度宽松并聚焦新质生产力。市场方面，A 股“结构性慢牛”格局未变，但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，盈利韧性较强的板块有望脱颖而出。

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、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，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，按照相关法律法规规定和基金合同、托管协议的有关约定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的约定进行。

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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“各关联方投资本基金的情况”和“金融工具风险及管理”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：华宝新活力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	3,202,032.53	3,001,182.74
结算备付金		773,963.02	2,461.87
存出保证金		44,813.95	5,340.70
交易性金融资产	6.4.7.2	57,700,008.27	38,877,370.74
其中：股票投资		57,700,008.27	38,877,370.74
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	-	-
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		-	9,900,958.94
应收股利		-	-
应收申购款		7,093.64	2,120.48
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		61,727,911.41	51,789,435.47
负 债 和 净 资 产			
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		2,968.32	-
应付赎回款		5,866.53	170,210.04
应付管理人报酬		29,717.57	25,203.46
应付托管费		7,429.38	6,300.84
应付销售服务费		9,994.75	10,501.45
应付投资顾问费		-	-
应交税费		68.32	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	393,782.08	176,996.92
负债合计		449,826.95	389,212.71
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	28,035,884.18	25,356,336.35
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	33,242,200.28	26,043,886.41
净资产合计		61,278,084.46	51,400,222.76
负债和净资产总计		61,727,911.41	51,789,435.47

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 28,035,884.18 份，其中华宝新活力混合 C 基金份额总额 22,379,481.60 份，基金份额净值 2.1852 元；华宝新活力混合 I 基金份额总额 5,656,402.58 份，基金份额净值 2.1877 元。

6.2 利润表

会计主体：华宝新活力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		4,295,216.65	1,735,521.09
1. 利息收入		11,473.33	32,958.88
其中：存款利息收入	6.4.7.9	11,473.33	32,863.57
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		-	95.31
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,010,401.57	288,782.26
其中：股票投资收益	6.4.7.10	2,709,621.86	-251,646.93
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-24,194.88

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	32,744.99	-
股利收益	6.4.7.15	268,034.72	564,624.07
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	1,270,301.08	1,385,276.59
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	3,040.67	28,503.36
减：二、营业总支出		343,642.49	319,500.89
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	179,956.43	147,911.16
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	44,989.03	36,977.84
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	63,703.23	61,629.69
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	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		125.88	17.35
8. 其他费用	6.4.7.19	54,867.92	72,964.85
三、利润总额(亏损总额以 “-”号填列)		3,951,574.16	1,416,020.20
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-” 号填列)		3,951,574.16	1,416,020.20
五、其他综合收益的税后净 额		-	-
六、综合收益总额		3,951,574.16	1,416,020.20

6.3 净资产变动表

会计主体：华宝新活力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	未分配利润	净资产合计

		收益		
一、上期期末净资产	25,356,336.35	-	26,043,886.41	51,400,222.76
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	25,356,336.35	-	26,043,886.41	51,400,222.76
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,679,547.83	-	7,198,313.87	9,877,861.70
（一）、综合收益总额	-	-	3,951,574.16	3,951,574.16
（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）	2,679,547.83	-	3,246,739.71	5,926,287.54
其中：1. 基金申购款	7,799,782.07	-	9,184,841.01	16,984,623.08
2. 基金赎回款	-5,120,234.24	-	-5,938,101.30	-11,058,335.54
（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	28,035,884.18	-	33,242,200.28	61,278,084.46
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	31,474,227.98	-	20,987,371.81	52,461,599.79
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	31,474,227.98	-	20,987,371.81	52,461,599.79
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-4,706,474.46	-	-1,606,896.35	-6,313,370.81
（一）、综合收益总额	-	-	1,416,020.20	1,416,020.20
（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）	-4,706,474.46	-	-3,022,916.55	-7,729,391.01
其中：1. 基金申购款	6,265,833.59	-	4,339,384.69	10,605,218.28
2. 基金赎回款	-10,972,308.05	-	-7,362,301.24	-18,334,609.29
（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	26,767,753.52	-	19,380,475.46	46,148,228.98

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

华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金（原名华宝兴业新活力灵活配置混合型证券投资基

金，以下简称“本基金”）系由基金管理人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》、《华宝兴业新活力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）及其他有关法律法规的规定，经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）以证监许可[2016]1593 号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期，首次设立募集基金份额为 593,079,676.11 份，经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验证，并出具了编号为德师报（验）字（16）第 0242 号的验资报告。基金合同于 2016 年 9 月 7 日正式生效。本基金的基金管理人为华宝基金管理有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

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》，华宝兴业新活力灵活配置混合型证券投资基金于 2017 年 12 月 30 日起更名为华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金。

根据《华宝基金管理有限公司关于华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金增加 I 类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告》，自 2025 年 4 月 18 日起，增设华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金 I 类基金份额，并相应修改基金合同等法律文件相关条款。增加 I 类基金份额后，本基金将设 C 类基金份额和 I 类基金份额两个基金份额类别，本基金原有份额调整为 C 类基金份额。本基金根据销售服务费率设置等事项的不同，将基金份额分为不同的类别。其中，从本类别基金资产中按 0.25% 的年费率计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额；从本类别基金资产中按 0.01% 的年费率计提销售服务费的基金份额，称为 I 类基金份额。两类基金份额分设不同的基金代码，并分别公布基金份额净值和基金份额累计净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》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（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）、资产支持证券等）和货币市场工具（包括质押及买断式回购、银行存款等）、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）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的比例为基金资产的 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，本基金保留的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；股指期货的投资比例

依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%。

本财务报表已于 2026 年 8 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照企业会计准则及其应用指南、准则解释及其他相关规定（包括《资产管理产品相关会计处理规定》）（以下统称企业会计准则）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的《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》、基金合同和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则的要求，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净资产变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令 826 号

《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《财政部 税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。2027 年 12 月 31 日前，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

2027 年 12 月 31 日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。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。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市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。

(4) 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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	3,202,032.53
等于：本金	3,201,676.78
加：应计利息	355.75
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	3,202,032.53

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		56,193,903.23	-	57,700,008.27	1,506,105.04
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		56,193,903.23	-	57,700,008.27	1,506,105.04

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	349,151.10
其中：交易所市场	349,151.10
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	44,630.98
合计	393,782.08

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

华宝新活力混合 C

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	25,356,336.35	25,356,336.35
本期申购	2,143,379.49	2,143,379.49
本期赎回（以“-”号填列）	-5,120,234.24	-5,120,234.24
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	22,379,481.60	22,379,481.60

华宝新活力混合 I

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	-	-
本期申购	5,656,402.58	5,656,402.58
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
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	5,656,402.58	5,656,402.58

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

华宝新活力混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	27,989,460.38	-1,945,573.97	26,043,886.41
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	27,989,460.38	-1,945,573.97	26,043,886.41
本期利润	2,635,139.81	1,301,935.13	3,937,074.94
本期基金份额交易产生的变动数	-3,567,981.14	111,123.43	-3,456,857.71
其中：基金申购款	2,523,152.81	-41,909.22	2,481,243.59
基金赎回款	-6,091,133.95	153,032.65	-5,938,101.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	27,056,619.05	-532,515.41	26,524,103.64

华宝新活力混合 I

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	46,133.27	-31,634.05	14,499.22
本期基金份额交易产生的变动数	6,806,514.22	-102,916.80	6,703,597.42
其中：基金申购款	6,806,514.22	-102,916.80	6,703,597.42
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,852,647.49	-134,550.85	6,718,096.64

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	8,076.31
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	3,310.89
其他	86.13

合计	11,473.33
----	-----------

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	499,368,659.00
减：卖出股票成本总额	495,902,892.72
减：交易费用	756,144.42
买卖股票差价收入	2,709,621.86

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益。

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	32,744.99

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	268,034.72
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	268,034.72

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	1,270,301.08
股票投资	1,270,301.08
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	1,270,301.08

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	3,036.15
基金转换费收入	4.52
合计	3,040.67

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	4,959.40
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行费用	936.56
账户维护费	9,000.00
上清所 CFCA 证书服务费	300.00
存托服务费	0.38
合计	54,867.92

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
中国民生银行股份有限公司(“民生银行”)	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	179,956.43	147,911.16
其中：应支付销售机构的客户维护费	27,339.16	29,604.21
应支付基金管理人的净管理费	152,617.27	118,306.95

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	44,989.03	36,977.84

注：支付基金托管民生银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15%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 × 0.15% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华宝新活力混合 C	华宝新活力混合 I	合计
华宝基金	38,243.02	470.05	38,713.07
华宝证券	6.51	-	6.51
民生银行	188.59	-	188.59
合计	38,438.12	470.05	38,908.17
获得销售服务费的各关联方名称	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销售服务费		
	华宝新活力混合 C	华宝新活力混合 I	合计
华宝基金	31,061.62	-	31,061.62
华宝证券	3,250.73	-	3,250.73
民生银行	138.05	-	138.05
合计	34,450.40	-	34,450.40

注：销售服务费每日计提，按月支付。C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.25%年费率计提。I 类基金份额的销售服务费按前一日 I 类基金份额的基金资产净值的 0.01%年费率计提。本基金各类基金份额销售服务费计提的计算方法如下：

C 类基金份额：H=E × 0.25%÷当年天数

I 类基金份额：H=E × 0.01%÷当年天数

H 为基金份额每日应计提的基金销售服务费；

E 为基金份额前一日基金资产净值。

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	
	华宝新活力混合 C	华宝新活力混合 I
基金合同生效日 (2016 年 9 月 7 日) 持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	13,875,868.37	-
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	13,875,868.37	-
报告期末持有的 基金份额 占基金总份额比例	62.00%	-
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 4 月 18 日(基金合同生效日) 至 2025 年 6 月 30 日
	华宝新活力混合 C	华宝新活力混合 I
基金合同生效日	-	-

（ 2016 年 9 月 7 日）持有的基金份额		
报告期初持有的基金份额	13,875,868.37	—
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	13,875,868.37	—
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	51.84%	—

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
民生银行	3,202,032.53	8,076.31	2,593,274.39	32,479.56

注：本基金的银行存款由基金托管人民生银行保管，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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
688121	*ST卓然	2026年5月6日	重大事项停牌	6.48	2026年7月7日	5.18	17,987	115,625.22	116,555.76	-
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	47	17,742.97	39,104.00	-
000524	岭南控股	2026年6月24日	重大事项停牌	8.95	2026年7月8日	9.85	3,900	34,086.00	34,905.00	-

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的证券投资基金，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同责任，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、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持证券部分在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为货币资金、结算备付金和存出保证金等。

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	3,202,032.53	-	-	-	3,202,032.53
结算备付金	773,963.02	-	-	-	773,963.02
存出保证金	44,813.95	-	-	-	44,813.95
交易性金融资产	-	-	-	57,700,008.27	57,700,008.27
应收申购款	-	-	-	7,093.64	7,093.64
资产总计	4,020,809.50	-	-	57,707,101.91	61,727,911.41
负债					
应付赎回款	-	-	-	5,866.53	5,866.53
应付管理人报酬	-	-	-	29,717.57	29,717.57

应付托管费	-	-	-	7,429.38	7,429.38
应付清算款	-	-	-	2,968.32	2,968.32
应付销售服务费	-	-	-	9,994.75	9,994.75
应交税费	-	-	-	68.32	68.32
其他负债	-	-	-	393,782.08	393,782.08
负债总计	-	-	-	449,826.95	449,826.95
利率敏感度缺口	4,020,809.50	-	-	57,257,274.96	61,278,084.46
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	3,001,182.74	-	-	-	3,001,182.74
结算备付金	2,461.87	-	-	-	2,461.87
存出保证金	5,340.70	-	-	-	5,340.70
交易性金融资产	-	-	-	38,877,370.74	38,877,370.74
应收申购款	-	-	-	2,120.48	2,120.48
应收清算款	-	-	-	9,900,958.94	9,900,958.94
资产总计	3,008,985.31	-	-	48,780,450.16	51,789,435.47
负债					
应付赎回款	-	-	-	170,210.04	170,210.04
应付管理人报酬	-	-	-	25,203.46	25,203.46
应付托管费	-	-	-	6,300.84	6,300.84
应付销售服务费	-	-	-	10,501.45	10,501.45
其他负债	-	-	-	176,996.92	176,996.92
负债总计	-	-	-	389,212.71	389,212.71
利率敏感度缺口	3,008,985.31	-	-	48,391,237.45	51,400,222.76

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，本基金未持有交易性债券投资(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。本基金通过投资组合的分散降低其他价格风险。

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	57,700,008.27	94.16	38,877,370.74	75.64
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	57,700,008.27	94.16	38,877,370.74	75.64

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	5,622,533.16	3,894,590.74
	2. 业绩比较基准下降 5%	-5,622,533.16	-3,894,590.74

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	57,509,443.51	38,289,427.74
第二层次	190,564.76	587,943.00
第三层次	—	—
合计	57,700,008.27	38,877,370.74

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	57,700,008.27	93.47
	其中：股票	57,700,008.27	93.47
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—

	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	3,975,995.55	6.44
8	其他各项资产	51,907.59	0.08
9	合计	61,727,911.41	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	203,363.80	0.33
B	采矿业	2,825,072.00	4.61
C	制造业	36,677,375.88	59.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,131,592.00	1.85
E	建筑业	122,809.00	0.20
F	批发和零售业	897,522.00	1.46
G	交通运输、仓储和邮政业	770,764.72	1.26
H	住宿和餐饮业	34,181.00	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,100,910.85	3.43
J	金融业	9,955,807.00	16.25
K	房地产业	1,276,475.00	2.08
L	租赁和商务服务业	139,089.00	0.23
M	科学研究和技术服务业	670,965.98	1.09
N	水利、环境和公共设施管理业	246,984.04	0.40
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	104,173.00	0.17
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	542,923.00	0.89
S	综合	-	-
	合计	57,700,008.27	94.16

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	000725	京东方 A	155,300	1,348,004.00	2.20
2	002281	光迅科技	4,200	1,079,148.00	1.76
3	600584	长电科技	8,600	890,530.00	1.45
4	002938	鹏鼎控股	8,100	853,578.00	1.39
5	301165	锐捷网络	9,600	772,320.00	1.26
6	688981	中芯国际	4,548	722,313.36	1.18
7	688469	芯联集成	67,603	717,267.83	1.17
8	601138	工业富联	9,600	692,640.00	1.13
9	600460	士兰微	12,500	683,250.00	1.11
10	601939	建设银行	70,100	675,063.00	1.10
11	002049	紫光国微	7,600	674,500.00	1.10
12	600703	三安光电	31,200	662,064.00	1.08
13	002415	海康威视	19,200	656,640.00	1.07
14	600030	中信证券	22,800	655,044.00	1.07
15	601398	工商银行	87,700	620,039.00	1.01
16	300033	同花顺	2,560	616,960.00	1.01
17	601318	中国平安	12,800	611,072.00	1.00
18	000338	潍柴动力	21,400	583,150.00	0.95
19	601288	农业银行	89,500	543,265.00	0.89
20	601211	国泰海通	29,800	542,360.00	0.89
21	300803	指南针	5,900	540,853.00	0.88
22	601088	中国神华	13,500	527,040.00	0.86
23	688378	奥来德	8,346	517,452.00	0.84
24	688266	泽璟制药	4,424	516,103.84	0.84
25	688559	海目星	6,103	512,163.76	0.84
26	688110	东芯股份	2,509	511,083.30	0.83
27	300857	协创数据	1,500	509,850.00	0.83
28	600203	福日电子	41,700	506,655.00	0.83
29	600105	永鼎股份	7,500	506,100.00	0.83
30	301536	星宸科技	3,900	501,969.00	0.82
31	001389	广合科技	2,100	498,225.00	0.81
32	301396	宏景科技	1,500	497,400.00	0.81
33	300475	香农芯创	1,600	480,000.00	0.78
34	603991	领先股份	3,400	479,910.00	0.78
35	300291	百纳千成	98,200	474,306.00	0.77
36	300672	国科微	1,600	472,000.00	0.77
37	688347	华虹宏力	1,402	471,492.60	0.77

38	600498	烽火通信	6,400	471,040.00	0.77
39	002484	江海股份	4,400	462,000.00	0.75
40	600036	招商银行	13,000	461,500.00	0.75
41	688387	信科移动	23,017	456,657.28	0.75
42	000007	全新好	36,500	452,600.00	0.74
43	000965	天保基建	153,900	449,388.00	0.73
44	600330	天通股份	14,400	444,096.00	0.72
45	600000	浦发银行	50,600	435,666.00	0.71
46	300853	申昊科技	14,100	435,549.00	0.71
47	688146	中船特气	1,228	429,787.72	0.70
48	600938	中国海油	14,900	404,535.00	0.66
49	000001	平安银行	40,100	403,005.00	0.66
50	300709	精研科技	6,900	388,125.00	0.63
51	601229	上海银行	44,200	383,656.00	0.63
52	688498	源杰科技	200	377,200.00	0.62
53	601658	邮储银行	75,500	372,215.00	0.61
54	600999	招商证券	17,400	367,140.00	0.60
55	601168	西部矿业	13,400	363,676.00	0.59
56	000776	广发证券	15,500	362,700.00	0.59
57	600989	宝丰能源	17,700	359,841.00	0.59
58	600011	华能国际	47,300	359,007.00	0.59
59	000333	美的集团	4,680	353,480.40	0.58
60	600362	江西铜业	8,100	350,730.00	0.57
61	600875	东方电气	12,100	348,117.00	0.57
62	600188	兖矿能源	19,300	342,961.00	0.56
63	002532	天山铝业	31,800	341,214.00	0.56
64	601998	中信银行	49,200	340,956.00	0.56
65	601009	南京银行	34,400	340,216.00	0.56
66	000933	神火股份	15,800	334,960.00	0.55
67	600346	恒力石化	18,300	324,093.00	0.53
68	688256	寒武纪	200	319,110.00	0.52
69	601066	中信建投	10,800	313,956.00	0.51
70	601699	潞安环能	21,400	305,592.00	0.50
71	002064	华峰化学	32,100	304,629.00	0.50
72	000027	深圳能源	48,800	302,560.00	0.49
73	688521	芯原股份	806	299,138.84	0.49
74	002056	横店东磁	9,800	298,704.00	0.49
75	603225	新凤鸣	14,900	292,785.00	0.48
76	002736	国信证券	29,100	290,709.00	0.47
77	002142	宁波银行	9,700	287,993.00	0.47
78	000039	中集集团	35,100	284,661.00	0.46
79	002156	通富微电	3,700	280,719.00	0.46
80	002120	韵达股份	43,800	278,568.00	0.45

81	000921	海信家电	10,000	273,200.00	0.45
82	001286	陕西能源	26,100	264,654.00	0.43
83	600522	中天科技	4,300	260,924.00	0.43
84	600720	中交设计	51,900	250,158.00	0.41
85	600801	华新建材	16,000	249,600.00	0.41
86	300551	古鳌科技	25,200	247,968.00	0.40
87	600487	亨通光电	2,100	229,614.00	0.37
88	601688	华泰证券	10,300	212,386.00	0.35
89	601233	桐昆股份	9,600	207,840.00	0.34
90	000623	吉林敖东	11,700	207,441.00	0.34
91	601166	兴业银行	12,300	203,688.00	0.33
92	601628	中国人寿	5,600	197,960.00	0.32
93	600026	中远海能	8,800	157,872.00	0.26
94	002407	多氟多	2,900	145,667.00	0.24
95	300308	中际旭创	100	127,000.00	0.21
96	688121	*ST 卓然	17,987	116,555.76	0.19
97	002558	巨人网络	3,600	99,216.00	0.16
98	002371	北方华创	100	88,456.00	0.14
99	300408	三环集团	500	83,450.00	0.14
100	603986	兆易创新	100	81,500.00	0.13
101	002384	东山精密	300	78,705.00	0.13
102	000708	中信特钢	6,100	76,982.00	0.13
103	600060	海信视像	2,700	75,249.00	0.12
104	002001	新 和 成	2,600	73,892.00	0.12
105	600985	淮北矿业	5,200	73,060.00	0.12
106	600941	中国移动	800	68,904.00	0.11
107	300604	长川科技	200	68,284.00	0.11
108	688019	安集科技	200	67,892.00	0.11
109	600887	伊利股份	2,300	55,108.00	0.09
110	601869	长飞光纤	100	54,590.00	0.09
111	603929	亚翔集成	200	54,404.00	0.09
112	688409	富创精密	170	52,062.50	0.08
113	603061	金海通	100	50,222.00	0.08
114	300223	北京君正	200	49,780.00	0.08
115	301369	联动科技	200	49,000.00	0.08
116	300502	新易盛	80	48,560.00	0.08
117	688120	华海清科	149	48,004.82	0.08
118	300274	阳光电源	300	47,706.00	0.08
119	300373	扬杰科技	300	47,169.00	0.08
120	688548	广钢气体	904	47,098.40	0.08
121	002463	沪电股份	300	45,840.00	0.07
122	002916	深南电路	100	45,790.00	0.07
123	002353	杰瑞股份	300	45,750.00	0.07

124	603186	华正新材	200	45,060.00	0.07
125	002008	大族激光	300	45,033.00	0.07
126	688578	艾力斯	409	44,662.80	0.07
127	605117	德业股份	420	44,595.60	0.07
128	688629	华丰科技	234	43,877.34	0.07
129	688012	中微公司	93	43,570.50	0.07
130	688396	华润微	444	43,312.20	0.07
131	300661	圣邦股份	300	43,044.00	0.07
132	601100	恒立液压	400	43,024.00	0.07
133	300054	鼎龙股份	400	42,388.00	0.07
134	300438	鹏辉能源	500	41,425.00	0.07
135	300285	国瓷材料	400	41,272.00	0.07
136	301093	华兰股份	300	40,689.00	0.07
137	601328	交通银行	6,300	40,509.00	0.07
138	688589	力合微	1,762	40,490.76	0.07
139	300953	震裕科技	300	40,110.00	0.07
140	688362	甬矽电子	416	40,102.40	0.07
141	603345	安井食品	500	40,095.00	0.07
142	300613	富瀚微	500	40,040.00	0.07
143	603179	新泉股份	800	39,720.00	0.06
144	301678	新恒汇	500	39,420.00	0.06
145	600482	中国动力	1,200	39,360.00	0.06
146	300568	星源材质	2,100	39,312.00	0.06
147	300750	宁德时代	100	39,301.00	0.06
148	688041	海光信息	106	39,251.80	0.06
149	002460	赣锋锂业	600	39,240.00	0.06
150	688072	拓荆科技	47	39,104.00	0.06
151	688301	奕瑞科技	315	39,060.00	0.06
152	301210	金杨精密	1,300	39,000.00	0.06
153	688235	百济神州	153	38,955.33	0.06
154	605123	派克新材	400	38,804.00	0.06
155	000021	深科技	600	38,562.00	0.06
156	688651	盛邦安全	1,195	38,502.90	0.06
157	688255	凯尔达	1,381	38,391.80	0.06
158	688279	峰昭科技	171	38,379.24	0.06
159	688008	澜起科技	123	38,117.70	0.06
160	603901	永创智能	3,500	38,045.00	0.06
161	002947	恒铭达	500	38,025.00	0.06
162	300201	海伦哲	1,800	37,926.00	0.06
163	002850	科达利	200	37,860.00	0.06
164	688155	先惠技术	467	37,775.63	0.06
165	688156	路德科技	1,246	37,691.50	0.06
166	603893	瑞芯微	200	37,672.00	0.06

167	603659	璞泰来	1,300	37,609.00	0.06
168	002518	科士达	700	37,513.00	0.06
169	600601	方正科技	2,700	37,368.00	0.06
170	603259	药明康德	300	37,353.00	0.06
171	301526	国际复材	800	37,336.00	0.06
172	603031	安孚科技	700	37,275.00	0.06
173	688372	伟测科技	200	37,200.00	0.06
174	300037	新宙邦	400	37,140.00	0.06
175	300398	飞凯材料	600	37,050.00	0.06
176	000603	盛达资源	1,600	36,960.00	0.06
177	688609	九联科技	3,353	36,916.53	0.06
178	603607	京华激光	1,500	36,900.00	0.06
179	300666	江丰电子	100	36,860.00	0.06
180	688435	英方软件	1,151	36,832.00	0.06
181	002635	安洁科技	1,800	36,810.00	0.06
182	002466	天齐锂业	600	36,792.00	0.06
183	688536	思瑞浦	101	36,773.09	0.06
184	300323	华灿光电	1,800	36,720.00	0.06
185	000100	TCL 科技	6,300	36,666.00	0.06
186	000703	恒逸石化	2,700	36,639.00	0.06
187	688331	荣昌生物	281	36,603.06	0.06
188	688067	爱威科技	1,814	36,552.10	0.06
189	688073	毕得医药	679	36,543.78	0.06
190	300904	威力传动	900	36,531.00	0.06
191	002134	天津普林	1,200	36,504.00	0.06
192	603583	捷昌驱动	1,600	36,480.00	0.06
193	688211	中科微至	1,059	36,450.78	0.06
194	003010	若羽臣	1,500	36,450.00	0.06
195	600176	中国巨石	500	36,440.00	0.06
196	600276	恒瑞医药	700	36,428.00	0.06
197	301487	盟固利	1,900	36,385.00	0.06
198	301085	亚康股份	600	36,366.00	0.06
199	001316	润贝航科	1,100	36,278.00	0.06
200	688518	联赢激光	1,173	36,245.70	0.06
201	000792	盐湖股份	1,200	36,228.00	0.06
202	300424	航新科技	2,300	36,202.00	0.06
203	300940	南极光	2,400	36,192.00	0.06
204	301355	南王科技	3,700	36,186.00	0.06
205	300432	富临精工	1,800	36,162.00	0.06
206	688356	键凯科技	469	36,150.52	0.06
207	601995	中金公司	1,000	36,150.00	0.06
208	600686	金龙汽车	3,200	36,128.00	0.06
209	002760	凤形股份	2,200	36,124.00	0.06

210	300955	嘉亨家化	1,000	36,090.00	0.06
211	002080	中材科技	400	36,000.00	0.06
212	688393	安必平	2,023	35,968.94	0.06
213	688135	利扬芯片	854	35,936.32	0.06
214	300417	南华仪器	3,500	35,910.00	0.06
215	002801	微光股份	1,300	35,880.00	0.06
215	300817	双飞股份	2,300	35,880.00	0.06
217	300590	移为通信	2,500	35,875.00	0.06
218	002240	盛新锂能	800	35,864.00	0.06
219	000061	农产品	6,400	35,840.00	0.06
220	002917	金奥博	3,400	35,836.00	0.06
221	300886	华业香料	1,800	35,820.00	0.06
222	002345	潮宏基	3,900	35,763.00	0.06
222	301503	智迪科技	1,300	35,763.00	0.06
224	688002	睿创微纳	231	35,733.39	0.06
225	002185	华天科技	1,600	35,696.00	0.06
226	300713	英可瑞	2,800	35,672.00	0.06
227	300851	交大思诺	1,600	35,600.00	0.06
228	000526	学大教育	1,400	35,532.00	0.06
229	688701	卓锦股份	4,718	35,526.54	0.06
230	300458	全志科技	900	35,514.00	0.06
231	002273	水晶光电	1,000	35,480.00	0.06
232	301129	瑞纳智能	1,700	35,479.00	0.06
233	688682	霍莱沃	912	35,476.80	0.06
234	300946	恒而达	900	35,451.00	0.06
235	301505	苏州规划	2,200	35,420.00	0.06
236	603979	金诚信	600	35,418.00	0.06
237	688058	宝兰德	1,693	35,417.56	0.06
238	688329	艾隆科技	1,752	35,407.92	0.06
239	688292	浩瀚深度	1,903	35,395.80	0.06
240	601208	东材科技	500	35,395.00	0.06
241	002738	中矿资源	600	35,394.00	0.06
242	301516	中远通	2,500	35,375.00	0.06
243	300685	艾德生物	2,100	35,364.00	0.06
244	300698	万马科技	1,300	35,360.00	0.06
245	002652	扬子新材	8,300	35,358.00	0.06
246	301131	聚赛龙	1,100	35,343.00	0.06
247	301335	天元宠物	1,800	35,334.00	0.06
248	002188	中天服务	7,200	35,280.00	0.06
249	300414	中光防雷	3,200	35,264.00	0.06
250	688021	奥福科技	1,821	35,254.56	0.06
251	002952	亚世光电	1,600	35,248.00	0.06
252	688410	山外山	2,454	35,239.44	0.06

253	001336	楚环科技	1,600	35,232.00	0.06
254	688296	和达科技	3,079	35,223.76	0.06
255	002645	华宏科技	1,280	35,212.80	0.06
256	603699	纽威股份	700	35,210.00	0.06
257	603709	中源家居	2,600	35,204.00	0.06
258	002475	立讯精密	500	35,200.00	0.06
259	688046	药康生物	1,454	35,186.80	0.06
260	300421	力星股份	1,900	35,169.00	0.06
261	603626	科森科技	1,900	35,150.00	0.06
262	002745	木林森	2,800	35,140.00	0.06
262	301006	迈拓股份	2,800	35,140.00	0.06
264	688092	爱科科技	1,654	35,130.96	0.06
265	688616	西力科技	3,478	35,127.80	0.06
266	301587	中瑞股份	1,600	35,120.00	0.06
267	300958	建工修复	3,300	35,112.00	0.06
268	002111	威海广泰	3,900	35,100.00	0.06
268	300822	贝仕达克	3,000	35,100.00	0.06
268	600784	鲁银投资	5,400	35,100.00	0.06
271	301180	万祥科技	2,800	35,084.00	0.06
272	603551	奥普科技	3,900	35,061.00	0.06
273	301515	港通医疗	2,000	35,060.00	0.06
274	603937	丽岛新材	2,500	35,050.00	0.06
275	688681	科汇股份	2,507	35,047.86	0.06
276	000856	冀东装备	4,900	35,035.00	0.06
277	002923	润都股份	3,700	35,002.00	0.06
278	002535	林州重机	15,900	34,980.00	0.06
279	300865	大宏立	1,600	34,960.00	0.06
280	601566	九牧王	4,300	34,959.00	0.06
281	301082	久盛电气	3,900	34,944.00	0.06
281	603101	汇嘉时代	5,600	34,944.00	0.06
283	300176	鸿特科技	7,200	34,920.00	0.06
284	002858	力盛体育	3,200	34,912.00	0.06
285	000524	岭南控股	3,900	34,905.00	0.06
286	688659	元琛科技	3,343	34,900.92	0.06
287	603686	福龙马	2,700	34,884.00	0.06
288	301199	迈赫股份	2,000	34,880.00	0.06
289	300793	佳禾智能	3,100	34,875.00	0.06
290	601677	明泰铝业	2,100	34,860.00	0.06
291	600066	宇通客车	1,300	34,853.00	0.06
292	003003	天元股份	3,500	34,825.00	0.06
293	603590	康辰药业	1,200	34,812.00	0.06
294	002487	大金重工	600	34,782.00	0.06
294	002659	凯文教育	9,300	34,782.00	0.06

294	300691	联合光电	2,200	34,782.00	0.06
294	300929	华骐环保	3,300	34,782.00	0.06
298	601001	晋控煤业	2,000	34,780.00	0.06
299	002863	今飞凯达	8,200	34,768.00	0.06
300	603162	海通发展	3,876	34,767.72	0.06
301	600692	亚通股份	6,400	34,752.00	0.06
302	600872	中炬高新	2,000	34,720.00	0.06
303	600778	友好集团	7,100	34,719.00	0.06
304	002593	日上集团	8,700	34,713.00	0.06
305	301167	建研设计	2,800	34,692.00	0.06
306	001366	播恩集团	3,200	34,688.00	0.06
307	002968	新大正	4,100	34,686.00	0.06
308	300972	万辰集团	200	34,682.00	0.06
309	600183	生益科技	200	34,680.00	0.06
310	000408	藏格矿业	500	34,660.00	0.06
311	688528	秦川物联	3,792	34,658.88	0.06
312	600233	圆通速递	2,200	34,650.00	0.06
313	300059	东方财富	1,700	34,646.00	0.06
314	300476	胜宏科技	100	34,643.00	0.06
315	603367	辰欣药业	2,700	34,641.00	0.06
316	600189	泉阳泉	4,600	34,638.00	0.06
317	600547	山东黄金	1,500	34,635.00	0.06
318	688565	力源科技	3,663	34,615.35	0.06
319	301567	贝隆精密	1,000	34,610.00	0.06
320	600886	国投电力	2,600	34,606.00	0.06
321	002028	思源电气	200	34,600.00	0.06
322	603739	蔚蓝生物	3,000	34,590.00	0.06
323	603588	高能环境	1,800	34,560.00	0.06
324	001379	腾达科技	2,200	34,540.00	0.06
325	603383	顶点软件	1,300	34,528.00	0.06
326	301300	远翔新材	1,100	34,507.00	0.06
327	603172	万丰股份	2,100	34,503.00	0.06
327	603810	丰山集团	3,100	34,503.00	0.06
329	600499	科达制造	2,500	34,500.00	0.06
330	688766	普冉股份	45	34,497.00	0.06
331	605122	四方新材	3,200	34,496.00	0.06
332	600159	大龙地产	15,600	34,476.00	0.06
333	002144	宏达高科	3,500	34,475.00	0.06
334	301429	森泰股份	2,200	34,474.00	0.06
335	603187	海容冷链	3,000	34,470.00	0.06
336	603396	金辰股份	1,300	34,450.00	0.06
337	002820	桂发祥	4,100	34,440.00	0.06
337	300471	厚普股份	4,000	34,440.00	0.06

337	300987	川网传媒	2,800	34,440.00	0.06
340	300500	启迪设计	3,900	34,437.00	0.06
341	300867	圣元环保	1,900	34,428.00	0.06
342	600540	新赛股份	10,400	34,424.00	0.06
343	301170	锡南科技	1,600	34,416.00	0.06
344	600900	长江电力	1,300	34,411.00	0.06
345	002873	新天药业	4,700	34,404.00	0.06
346	002016	世荣兆业	8,600	34,400.00	0.06
346	002629	仁智股份	8,000	34,400.00	0.06
346	601218	吉鑫科技	8,000	34,400.00	0.06
349	600858	银座股份	7,800	34,398.00	0.06
349	603127	昭衍新药	900	34,398.00	0.06
351	000607	华媒控股	11,200	34,384.00	0.06
352	300675	建科院	2,900	34,365.00	0.06
352	605180	华生科技	2,900	34,365.00	0.06
354	605567	春雪食品	4,300	34,357.00	0.06
355	000301	东方盛虹	3,000	34,350.00	0.06
356	300681	英搏尔	1,200	34,344.00	0.06
357	603900	莱绅通灵	6,100	34,343.00	0.06
358	000573	粤宏远 A	9,700	34,338.00	0.06
359	600796	钱江生化	7,400	34,336.00	0.06
360	003016	欣贺股份	5,600	34,328.00	0.06
361	300829	金丹科技	2,500	34,325.00	0.06
362	603708	家家悦	4,000	34,320.00	0.06
363	600099	林海股份	4,300	34,314.00	0.06
363	601985	中国核电	3,800	34,314.00	0.06
365	600785	新华百货	3,500	34,300.00	0.06
365	600883	博闻科技	4,900	34,300.00	0.06
367	300658	延江股份	3,000	34,290.00	0.06
368	300220	金运激光	3,300	34,287.00	0.06
369	300875	捷强装备	1,200	34,284.00	0.06
370	600595	中孚实业	6,100	34,282.00	0.06
371	603536	惠发食品	4,400	34,276.00	0.06
372	002591	恒大高新	5,600	34,272.00	0.06
373	000421	南京公用	6,900	34,224.00	0.06
374	603041	美思德	3,300	34,221.00	0.06
375	600988	赤峰黄金	1,300	34,216.00	0.06
376	301010	晶雪节能	2,100	34,209.00	0.06
376	301153	中科江南	2,100	34,209.00	0.06
378	600309	万华化学	500	34,205.00	0.06
379	000505	京粮控股	6,800	34,204.00	0.06
380	002458	益生股份	4,400	34,188.00	0.06
381	600754	锦江酒店	1,900	34,181.00	0.06

382	603066	音飞储存	3,500	34,160.00	0.06
383	688183	生益电子	258	34,159.20	0.06
384	600561	江西长运	6,900	34,155.00	0.06
385	000960	锡业股份	800	34,152.00	0.06
385	000985	大庆华科	2,400	34,152.00	0.06
387	002517	恺英网络	2,100	34,125.00	0.06
387	300610	晨化股份	3,500	34,125.00	0.06
387	301277	新天地	3,900	34,125.00	0.06
390	300582	英飞特	2,800	34,104.00	0.06
390	600871	石化油服	16,800	34,104.00	0.06
392	600638	新黄浦	7,800	34,086.00	0.06
393	600137	浪莎股份	2,100	34,083.00	0.06
394	002772	众兴菌业	3,000	34,080.00	0.06
395	688710	益诺思	507	34,070.40	0.06
396	600493	凤竹纺织	6,500	34,060.00	0.06
397	000953	中哲精化	6,600	34,056.00	0.06
398	301136	招标股份	3,100	34,038.00	0.06
399	001378	德冠新材	1,900	34,029.00	0.06
400	301192	泰祥股份	1,800	34,020.00	0.06
400	600232	金鹰股份	5,400	34,020.00	0.06
400	600697	欧亚集团	3,500	34,020.00	0.06
403	600073	光明肉业	7,300	34,018.00	0.06
404	002953	日丰股份	3,900	34,008.00	0.06
405	000975	山金国际	2,000	34,000.00	0.06
406	002756	永兴材料	600	33,984.00	0.06
406	300597	吉大通信	4,800	33,984.00	0.06
408	002379	宏桥控股	2,300	33,971.00	0.06
409	300662	科锐国际	2,000	33,960.00	0.06
409	603079	圣达生物	3,000	33,960.00	0.06
411	603059	倍加洁	1,400	33,950.00	0.06
412	600429	三元股份	8,400	33,936.00	0.06
413	002562	兄弟科技	7,800	33,930.00	0.06
413	603190	亚通精工	1,500	33,930.00	0.06
415	002140	东华科技	3,700	33,929.00	0.06
416	002295	精艺股份	4,000	33,920.00	0.06
417	603214	爱婴室	2,800	33,908.00	0.06
418	002679	福建金森	4,300	33,884.00	0.06
419	600546	山煤国际	3,100	33,883.00	0.06
420	301456	盘古智能	1,500	33,870.00	0.06
421	600320	振华重工	8,200	33,866.00	0.06
422	600661	昂立教育	4,900	33,859.00	0.06
423	601155	新城控股	3,300	33,858.00	0.06
424	603317	天味食品	2,600	33,826.00	0.06

425	002286	保龄宝	4,100	33,825.00	0.06
425	603933	睿能科技	1,500	33,825.00	0.06
427	002357	富临运业	3,800	33,820.00	0.06
428	603876	鼎胜新材	1,300	33,813.00	0.06
429	600731	湖南海利	6,600	33,792.00	0.06
430	600150	中国船舶	1,000	33,790.00	0.06
431	603799	华友钴业	700	33,782.00	0.06
432	600444	国机通用	2,600	33,748.00	0.06
433	605189	富春染织	2,800	33,740.00	0.06
434	601958	金钼股份	1,200	33,732.00	0.06
435	000630	铜陵有色	5,300	33,708.00	0.06
435	002886	沃特股份	1,200	33,708.00	0.06
437	300788	中信出版	1,500	33,705.00	0.06
438	601600	中国铝业	4,100	33,702.00	0.05
439	300511	雪榕生物	6,700	33,701.00	0.05
440	301507	民生健康	2,800	33,684.00	0.05
441	003022	联泓新科	1,300	33,670.00	0.05
442	002802	洪汇新材	3,200	33,664.00	0.05
443	000514	渝开发	9,400	33,652.00	0.05
444	000036	华联控股	7,700	33,649.00	0.05
445	600111	北方稀土	700	33,635.00	0.05
446	300592	华凯易佰	1,900	33,630.00	0.05
447	603506	南都物业	3,600	33,624.00	0.05
448	301056	森赫股份	3,000	33,600.00	0.05
449	002748	世龙实业	3,200	33,536.00	0.05
450	002624	完美世界	2,700	33,534.00	0.05
451	600018	上港集团	7,100	33,512.00	0.05
452	000923	河钢资源	2,700	33,507.00	0.05
452	600282	南钢股份	7,300	33,507.00	0.05
454	601918	新集能源	3,900	33,501.00	0.05
455	600426	华鲁恒升	1,400	33,488.00	0.05
456	000685	中山公用	3,000	33,480.00	0.05
457	002812	恩捷股份	500	33,455.00	0.05
458	600028	中国石化	7,500	33,450.00	0.05
459	600919	江苏银行	3,100	33,418.00	0.05
460	300483	首华燃气	1,900	33,402.00	0.05
461	002365	永安药业	3,300	33,396.00	0.05
462	688799	华纳药厂	744	33,383.28	0.05
463	603993	洛阳钼业	1,900	33,345.00	0.05
464	603711	香飘飘	3,000	33,330.00	0.05
465	002493	荣盛石化	3,100	33,325.00	0.05
466	600663	陆家嘴	5,300	33,284.00	0.05
467	002054	德美化工	5,000	33,250.00	0.05

468	002271	东方雨虹	2,800	33,236.00	0.05
469	300442	润泽科技	400	33,228.00	0.05
470	600094	大名城	9,600	33,216.00	0.05
470	601728	中国电信	6,400	33,216.00	0.05
472	000807	云铝股份	1,500	33,210.00	0.05
472	001215	千味央厨	900	33,210.00	0.05
474	600389	江山股份	1,700	33,184.00	0.05
475	002278	神开股份	4,400	33,176.00	0.05
476	001373	翔腾新材	1,100	33,165.00	0.05
477	600029	南方航空	6,400	33,152.00	0.05
478	601919	中远海控	2,500	33,150.00	0.05
479	002752	昇兴股份	6,000	33,120.00	0.05
480	301027	华蓝集团	1,600	33,104.00	0.05
481	001218	丽臣实业	1,500	33,090.00	0.05
482	300970	华绿生物	1,810	33,086.80	0.05
483	601069	西部黄金	1,500	33,000.00	0.05
484	601857	中国石油	3,800	32,984.00	0.05
485	000949	新乡化纤	5,200	32,968.00	0.05
486	000426	兴业银锡	1,000	32,960.00	0.05
487	001203	大中矿业	1,100	32,945.00	0.05
488	002541	鸿路钢构	1,900	32,908.00	0.05
489	603507	振江股份	1,000	32,890.00	0.05
490	002648	卫星化学	1,400	32,886.00	0.05
490	601898	中煤能源	2,700	32,886.00	0.05
492	600031	三一重工	1,900	32,832.00	0.05
493	688111	金山办公	154	32,809.70	0.05
494	002440	闰土股份	3,200	32,800.00	0.05
495	000893	亚钾国际	800	32,712.00	0.05
496	601881	中国银河	2,600	32,682.00	0.05
496	601899	紫金矿业	1,300	32,682.00	0.05
498	601225	陕西煤业	1,600	32,560.00	0.05
499	688059	华锐精密	163	32,552.73	0.05
500	600230	沧州大化	2,500	32,550.00	0.05
501	600489	中金黄金	1,800	32,490.00	0.05
502	002545	东方铁塔	2,000	32,440.00	0.05
503	002821	凯莱英	200	32,400.00	0.05
503	601231	环旭电子	1,000	32,400.00	0.05
505	002128	电投能源	1,400	32,368.00	0.05
506	603939	益丰药房	1,800	32,364.00	0.05
507	688113	联测科技	919	32,256.90	0.05
508	688615	合合信息	284	32,120.40	0.05
509	603790	雅运股份	1,500	32,010.00	0.05
510	688700	东威科技	358	32,005.20	0.05

511	600596	新安股份	2,000	31,920.00	0.05
512	002594	比亚迪	400	31,880.00	0.05
513	601872	招商轮船	1,800	31,626.00	0.05
514	688257	新锐股份	309	31,487.10	0.05
515	600497	驰宏锌锗	2,600	31,486.00	0.05
516	688390	固德威	289	31,359.39	0.05
517	601975	招商南油	8,400	31,332.00	0.05
518	688717	艾罗能源	374	30,881.18	0.05
519	688778	厦钨新能	566	30,790.40	0.05
520	000657	中钨高新	300	28,716.00	0.05
521	300346	南大光电	300	27,795.00	0.05
522	600335	国机汽车	1,200	5,616.00	0.01
523	000651	格力电器	100	3,750.00	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	000063	中兴通讯	1,505,807.00	2.93
2	000725	京东方 A	1,341,894.00	2.61
3	688061	灿瑞科技	1,316,096.37	2.56
4	301589	诺瓦星云	1,087,467.00	2.12
5	002281	光迅科技	1,074,775.00	2.09
6	301536	星宸科技	1,044,894.00	2.03
7	688702	盛科通信	1,007,593.96	1.96
8	300079	数码视讯	993,815.00	1.93
9	688085	三友医疗	987,981.79	1.92
10	688301	奕瑞科技	954,014.00	1.86
11	600584	长电科技	948,272.00	1.84
12	600036	招商银行	935,643.00	1.82
13	002938	鹏鼎控股	908,997.00	1.77
14	601939	建设银行	893,436.00	1.74
15	601799	星宇股份	884,326.00	1.72
16	688378	奥来德	871,367.89	1.70
17	603856	东宏股份	858,376.00	1.67
18	601166	兴业银行	857,824.00	1.67
19	688026	洁特生物	847,702.38	1.65
20	601628	中国人寿	841,381.00	1.64

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	688061	灿瑞科技	1,566,595.12	3.05

2	000063	中兴通讯	1, 442, 571. 00	2. 81
3	688702	盛科通信	1, 212, 016. 73	2. 36
4	688085	三友医疗	1, 192, 406. 92	2. 32
5	688301	奕瑞科技	1, 177, 992. 96	2. 29
6	300861	美畅股份	1, 160, 913. 28	2. 26
7	688158	优刻得	1, 142, 598. 90	2. 22
8	300373	扬杰科技	1, 072, 880. 00	2. 09
9	301589	诺瓦星云	1, 050, 005. 00	2. 04
10	300079	数码视讯	1, 040, 033. 00	2. 02
11	300223	北京君正	978, 228. 00	1. 90
12	688597	煜邦电力	945, 715. 62	1. 84
13	300994	久祺股份	942, 387. 00	1. 83
14	003025	思进智能	910, 127. 00	1. 77
15	688026	洁特生物	886, 875. 54	1. 73
16	601799	星宇股份	884, 285. 00	1. 72
17	688272	富吉瑞	874, 345. 33	1. 70
18	603856	东宏股份	874, 000. 00	1. 70
19	688091	上海谊众	859, 023. 27	1. 67
20	301511	德福科技	826, 739. 00	1. 61

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	513, 455, 229. 17
卖出股票收入（成交）总额	499, 368, 659. 00

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资于股指期货，旨在灵活调整敞口，配合日常流动性管理，以更好地实现投资目标。

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

华宝新活力混合截止 2026 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,中国建设银行股份有限公司因个别信息系统开发测试不充分、信息科技外包管理存在不足等事项;于 2025 年 09 月 12 日收到金融监管总局罚款的处罚措施。

华宝新活力混合截止 2026 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,中国建设银行股份有限公司因: 1. 违反账户管理规定; 2. 违反特约商户管理规定; 3. 违反人民币流通管理规定; 4. 违反反假货币业务管理规定; 5. 占压财政存款或资金; 6. 违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定; 7. 未按规定履行客户身份识别义务; 8. 未按规定保存客户身份资料和交易记录; 9. 未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告; 10. 与身份不明的客户进行交易; 于 2026 年 02 月 14 日收到中国人民银行警告, 罚款, 没收违法所得的处罚措施。

华宝新活力混合截止 2026 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,中国建设银行股份有限公司因重要信息系统投产变更风险管控不到位、重要信息系统应急管理不足等; 于 2026 年 06 月 05 日收到金融监管总局罚款的处罚措施。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和视为, 认为上述处分不会对公司的投资价值构成实质性影响, 因此本基金管理人对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	44,813.95
2	应收清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	7,093.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	51,907.59

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

份额级别	持有人 户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
华宝新活 力混合 C	4,191	5,339.89	14,213,744.13	63.51	8,165,737.47	36.49
华宝新活 力混合 I	2	2,828,201.29	5,488,976.30	97.04	167,426.28	2.96
合计	4,193	6,686.35	19,702,720.43	70.28	8,333,163.75	29.72

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（%）	95.40

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管 理人所有从业 人员持有本基 金	华宝新活力混合 C	207,009.66	0.9250
	华宝新活力混合 I	167,426.28	2.9599

	合计	374, 435. 94	1. 3356
--	----	--------------	---------

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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华宝新活力混合 C	0
	华宝新活力混合 I	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	华宝新活力混合 C	0
	华宝新活力混合 I	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华宝新活力混合 C	华宝新活力混合 I
基金合同生效日 （2016 年 9 月 7 日） 基金份额总额	593, 079, 676. 11	—
本报告期期初基金份 额总额	25, 356, 336. 35	—
本报告期基金总申购 份额	2, 143, 379. 49	5, 656, 402. 58
减：本报告期基金总 赎回份额	5, 120, 234. 24	—
本报告期基金拆分变 动份额	—	—
本报告期期末基金份 额总额	22, 379, 481. 60	5, 656, 402. 58

§ 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、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10. 3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产和公募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：2025 年 11 月 11 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

本报告期内，未收到关于证券投资基金托管业务受调查或处罚的情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，未收到证券投资基金托管业务相关从业人员受调查或处罚的情况。

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 (%)	
东方证券	1	522,878,057.36	51.63	227,950.21	51.63	-
广发证券	1	489,945,830.81	48.37	213,570.01	48.37	-
中信证券	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: 实力雄厚，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. 本期交易单元未发生变化。

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

本基金本报告期内未租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

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	华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）	基金管理人网站	2026-01-06
2	华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站	2026-01-06
3	华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金（I 类份额）基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站	2026-01-06
4	华宝新活力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
5	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	2026-01-23
6	华宝新活力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
7	华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	基金管理人网站, 证券日报	2026-04-10
8	华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）	基金管理人网站	2026-04-14
9	华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金（I 类份额）基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站	2026-04-14
10	华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站	2026-04-14
11	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
12	华宝新活力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
13	华宝基金关于旗下部分基金新增中国	基金管理人网站, 上海	2026-06-04

	邮政储蓄银行股份有限公司为代销机构的公告	证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	
14	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
15	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

§ 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20260101~20260630	13,875,868.37	0.00	0.00	13,875,868.37	49.49
产品特有风险							
报告期内本基金出现单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况。 在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下, 如该投资者集中赎回, 可能会增加基金的流动性风险。此外, 由于基金在遇到大额赎回的时候可能需要变现部分资产, 可能对持有资产的价格形成冲击, 增加基金的市场风险。基金管理人将专业审慎、勤勉尽责地运作基金资产, 加强防范流动性风险、市场风险, 保护持有人利益。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 中国证监会批准基金设立的文件;
- 华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金基金合同;
- 华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金招募说明书;
- 华宝新活力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及基金托管人办公场所备投资者查阅。

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