

华宝安睿债券型证券投资基金

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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	14
§ 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	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
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	48
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	48
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	48

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	48
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.11 投资组合报告附注	49
§ 8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	50
§ 9 开放式基金份额变动	51
§ 10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
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	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	51
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	52
10.8 其他重大事件	53
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	53
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	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	53
§ 12 备查文件目录	54
12.1 备查文件目录	54
12.2 存放地点	54
12.3 查阅方式	54

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝安睿债券型证券投资基金	
基金简称	华宝安睿债券	
基金主代码	023802	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 9 月 19 日	
基金管理人	华宝基金管理有限公司	
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	416,932,715.12 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	华宝安睿债券 A	华宝安睿债券 C
下属分级基金的交 易代码	023802	023803
报告期末下属分级 基金的份额总额	416,927,731.07 份	4,984.05 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制投资组合下行风险的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金通过对宏观经济运行状况、货币政策变化、市场利率走势、市场资金供求情况、经济周期等要素的定性与定量分析，预测大类资产未来收益率变化情况，在不同的大类资产之间进行动态调整和优化，以规避市场风险，提高基金收益率。 当预期宏观基本面向好、通胀稳定且股票估值合理或低估时，本基金将增加股票、可转换债券和可交换债券的资产比例，减少信用债和其他债券类资产的比例；当预期宏观基本面向弱、或通胀预期较高、或股票估值泡沫比较明显时，本基金将采取相对稳健的操作，减少股票、可转换债券和可交换债券的资产比例，增加信用债和其他债券类资产比例。
业绩比较基准	中证综合债指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险理论上高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。本基金投资范围包括股票、可转换债券和可交换债券，预期收益和风险水平高于纯债债券型基金。

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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周雷	张姗
	联系电话	021-38505888	400-61-95555
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-700-5588、400-820-5050	400-61-95555

传真	021-38505777	0755-83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	200120	518040
法定代表人	夏雪松	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	上海证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金中期报告置备地点	基金管理人办公场所和基金托管人办公场所。

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)	
	华宝安睿债券 A	华宝安睿债券 C
本期已实现收益	3,991,886.19	46.74
本期利润	11,771,810.21	139.49
加权平均基金份额本期利润	0.0301	0.0280
本期加权平均净值利润率	2.95%	2.75%
本期基金份额净值增长率	2.94%	2.79%
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	5,597,499.55	55.55

期末可供分配基金份额利润	0.0134	0.0111
期末基金资产净值	431,309,644.24	5,144.48
期末基金份额净值	1.0345	1.0322
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	3.45%	3.22%

- 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

华宝安睿债券 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	2.33%	0.22%	2.26%	0.14%	0.07%	0.08%
过去六个月	2.94%	0.21%	2.63%	0.12%	0.31%	0.09%
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	3.45%	0.18%	3.20%	0.11%	0.25%	0.07%

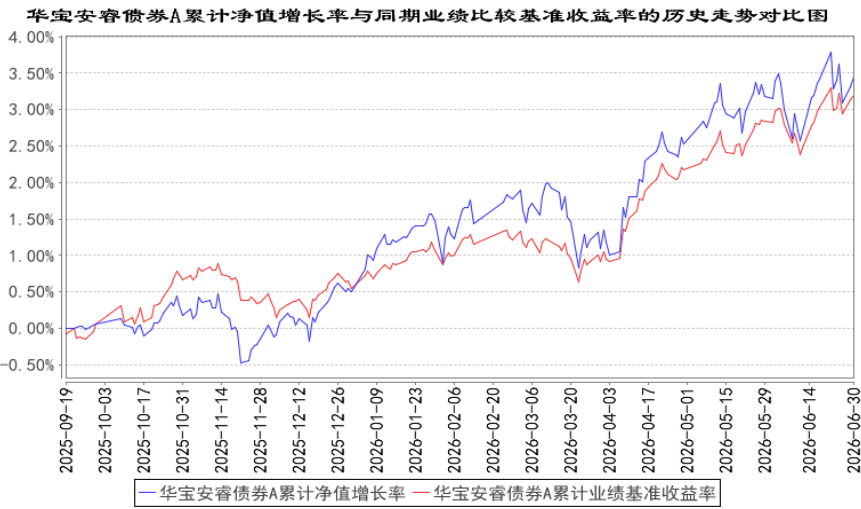
华宝安睿债券 C

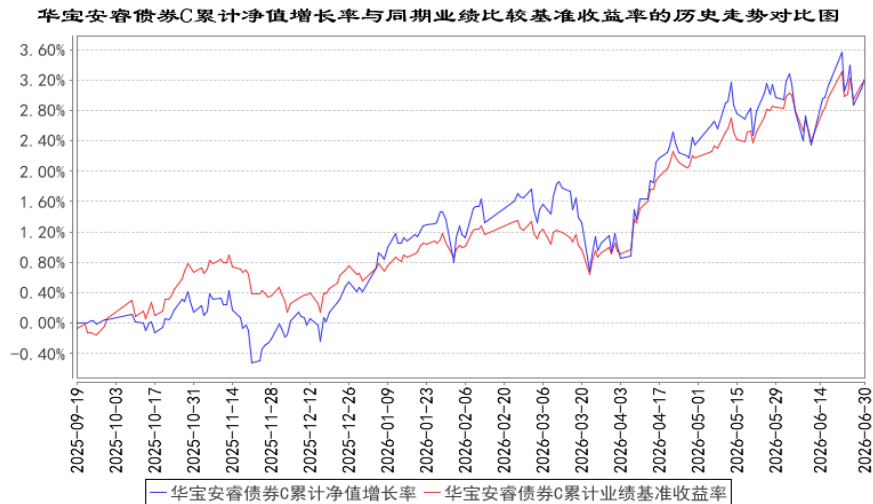
阶段	份额净值增	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基	①－③	②－④
----	-------	-------	-------	-------	-----	-----

	长率①	长率标准差②	准收益率③	准收益率标准差④		
过去三个月	2.26%	0.22%	2.26%	0.14%	0.00%	0.08%
过去六个月	2.79%	0.21%	2.63%	0.12%	0.16%	0.09%
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	3.22%	0.18%	3.20%	0.11%	0.02%	0.07%

注：（1）基金业绩基准：中证综合债指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%；
（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：1、本基金基金合同生效于 2025 年 09 月 19 日，截止报告日本基金基金合同生效未满一年。

2、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六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 2026 年 03 月 19 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		
唐雪倩	本基金基金经理	2025-09-19	-	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。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。
林昊	本基金基金经理	2025-09-19	-	20 年	硕士。2006 年 5 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任渠道经理、交易员、高级交易员、基金经理助理等职务。2017 年 3 月起任华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 3 月至 2023 年 3 月任华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 12 月至 2018 年 7 月任华宝新回报一年定期开放混合型证券投资基金基金经理，2017 年 12 月至 2018 年 6 月任华宝新动力一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 12 月至 2018 年 12 月任华宝新优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018 年 8 月至 2021 年 3 月任华宝宝丰高等级债券型发起式证券投资基金基金经理，2019 年 11 月起任华宝宝惠纯债 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，2020 年 7 月起任华宝宝利纯债 86 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，2020 年 9 月起任华宝中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金基金经理，2021 年 6 月至 2023 年 3 月任华宝安盈混合型证券投资基金基金经理，2021 年 8 月起任华宝安享混合型证券投资基金基金经理，2021 年 9 月至 2022 年 6 月任华宝安益混合型证券投资基金基金经理，2025 年 9 月起任华宝安睿债券型

					证券投资基金基金经理，2026 年 4 月起任华宝安润六个月持有期债券型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期内，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制，确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求，分析了本公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差；分析结果未发现异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，本基金没有发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年债券市场收益率整体呈震荡下行的走势。一季度债市表现为急跌缓修复特征，春节后逆风因素逐步累积，叠加地缘因素扰动与通胀抬升预期升温，推动超长端收益率上行；进

入二季度，受宏观数据结构性分化、政府债净供给节奏偏慢和流动性充裕等因素共同驱动，长短端收益率整体同步下行。经济数据方面，4-6 月制造业 PMI 分别为 50.3%、50.0%和 50.3%，连续三个月位于扩张区间但扩张力度较缓；6 月规模以上工业增加值同比增长 5.3%，制造业设备更新持续推进，铁路船舶航空航天等运输设备制造业保持 24.7%的高速增长。投资端整体仍在深度调整，1-6 月固定资产投资同比下降 5.7%，其中制造业投资下降 1.2%，设备工器具购置投资仍保持 8.1%的正增长，房地产开发投资同比下降 18.0%，新开工面积下降 23.4%。消费端温和恢复，6 月社会消费品零售总额同比增长 1.0%，上半年累计增长 1.3%，汽车类零售额同比下降 16.1%仍为重要拖累。通胀总体温和，6 月 CPI 同比上涨 1.0%，核心 CPI 同比上涨 1.0%，PPI 同比上涨 4.1%，主要受煤炭、有色金属等涨价驱动，但国际原油价格环比下行，上游涨价向中下游传导仍存在梗阻。金融数据方面，6 月新增人民币贷款 1.61 万亿元，新增社融 3.36 万亿元，同比增速均小幅回落，实体经济融资需求仍有待恢复。货币政策维持适度宽松，央行通过 MLF 超额投放、公开市场精准操作等方式灵活调节流动性，资金面整体保持均衡宽松。整体来看，无风险收益率曲线呈现平坦化走势，1 年国债、国开较去年末分别上行 22BP、20BP 至 1.12%、1.35%；10 年国债、国开较去年末分别下行 21BP、22BP 至 1.73%和 1.78%。

权益市场方面，2026 年上半年，市场在一季度下旬受地缘冲突的影响一度略有扰动，但总体呈现极强的 K 型特征，整体权益市场波动中上行，呈现极端的一九行情，科技及成长赛道快速估值拔升，其余板块不同程度回落。科技是上半年 A 股逻辑和业绩叙事的核心，但与此同时，这也推动市场的分化程度到达历史极值，截止二季度末，31 个申万一级行业首尾季度收益差超过 110%，处于 2015 年初以来过去十一年半的历史最高点；成长特别是 AI 链条对于其它市场板块的虹吸效应明显，前 20%的股票占据了全市场 75%的流动性，其中前 18 只股票的季度成交额占两市 5200 只股票总成交额的比例超过 10%。进入半年报季，业绩的验证性仍将成为估值的重要支撑，投资端将更加关注业绩边际态势在选股中的重要作用。

华宝安睿基金在上半年维持了较高的债券投资比例和适度的组合久期，在市场大幅波动中，尽可能地降低组合净值回撤。本基金将继续保持较高的债券投资比例，始终坚持绝对收益的投资目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额 A 类净值增长率为 2.94%，本报告期基金份额 C 类净值增长率为 2.79%；同期业绩比较基准收益率为 2.63%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，重要会议肯定经济“动能向新、结构向优”的同时，强调“高度重视经济运行中的

困难挑战”，要求实施好更加积极的财政政策和适度宽松的货币政策。财政支出和债券资金使用在上半年进度偏慢，后续财政有望加快支出和债券资金使用，有力推进“两重、两新”工作，新增专项债、超长期特别国债发行提速及 8000 亿元新型政策性金融工具也将加快落地。货币政策在保持适度宽松基调下，提出“综合运用并适时调整货币政策工具”，并新增“优化实施财政金融协同促内需政策”的表述，降准降息仍有政策空间。对于债券市场，基本面弱修复、流动性充裕以及机构欠配逻辑延续的环境下，收益率大概率维持低位震荡，信用利差有望继续压缩。权益市场的机会则将主要围绕“十五五”规划、“六张网”建设以及制造业升级等方向展开。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人低于二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：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遵规守信、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华宝安睿债券型证券投资基金

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	879,823.95	115,945.61
结算备付金		92,065.26	2,271,767.42
存出保证金		12,340.19	13,117.38
交易性金融资产	6.4.7.2	431,530,847.50	362,257,069.99
其中：股票投资		84,060,234.38	66,545,891.90
基金投资		-	-
债券投资		347,470,613.12	295,711,178.09
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	-	8,997,802.71
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		-	603,657.31
应收股利		-	-
应收申购款		1,722,658.11	199.20
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		434,237,735.01	374,259,559.62
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		1,980,089.51	-
应付清算款		-	77,172.51
应付赎回款		565,758.36	235,983.35
应付管理人报酬		203,309.78	199,916.77
应付托管费		50,827.43	49,979.19
应付销售服务费		1.20	1.24
应付投资顾问费		-	-
应交税费		4.21	6.82
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	122,955.80	93,587.42
负债合计		2,922,946.29	656,647.30
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	416,932,715.12	371,732,143.01
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	14,382,073.60	1,870,769.31
净资产合计		431,314,788.72	373,602,912.32
负债和净资产总计		434,237,735.01	374,259,559.62

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 416,932,715.12 份，其中华宝安睿债券 A 基金份额总额 416,927,731.07 份，基金份额净值 1.0345 元；华宝安睿债券 C 基金份额总额 4,984.05 份，基金份额净值 1.0322 元。

6.2 利润表

会计主体：华宝安睿债券型证券投资基金

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
一、营业总收入		13,457,798.01
1. 利息收入		10,146.64
其中：存款利息收入	6.4.7.9	4,434.51
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		5,712.13
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		5,660,173.05
其中：股票投资收益	6.4.7.10	969,340.99
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	3,690,721.64
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	-
股利收益	6.4.7.15	1,000,110.42
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	7,780,016.77
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	7,461.55
减：二、营业总支出		1,685,848.31
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,179,295.17
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	294,823.76
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	7.24
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		125,837.05
其中：卖出回购金融资产支出		125,837.05
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-
7. 税金及附加		0.68
8. 其他费用	6.4.7.19	85,884.41
三、利润总额（亏损总额以“-”号 填列）		11,771,949.70
减：所得税费用		-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		11,771,949.70
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		11,771,949.70

注：本产品成立于 2025 年 09 月 19 日，故无上年度可比期间。

6.3 净资产变动表

会计主体：华宝安睿债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	371,732,143.01	-	1,870,769.31	373,602,912.32
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	371,732,143.01	-	1,870,769.31	373,602,912.32
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	45,200,572.11	-	12,511,304.29	57,711,876.40
（一）、综合收益总额	-	-	11,771,949.70	11,771,949.70
（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）	45,200,572.11	-	739,354.59	45,939,926.70
其中：1. 基金申购款	342,065,789.15	-	6,945,099.24	349,010,888.39
2. 基金赎回款	- 296,865,217.04	-	-6,205,744.65	-303,070,961.69
（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	416,932,715.12	-	14,382,073.60	431,314,788.72

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

华宝安睿债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可〔2025〕第 493 号《关于准予华宝安睿债券型证券投资基金注册的批复》注册，由华宝基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝安睿债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 409,887,166.11 元，业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2025)验字第 70072895_B25 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华宝安睿债券型证券投资基金基金合同》于 2025 年 9 月 19 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 409,896,929.12 份基金份额，其中认购资金利息折合 9,763.01 份基金份额。本基金的基金管理人为华宝基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《华宝安睿债券型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝安睿债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会允许基金投资的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债、政府支

持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款等)、国债期货、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。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:本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%;投资于股票、可转换债券和可交换债券的比例合计不超过基金资产的 20%;每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,保持现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为:中证综合债指数收益率 $\times$ 90%+沪深 300 指数收益率 $\times$ 10%。

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	879,823.95
等于：本金	879,641.75
加：应计利息	182.20
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	879,823.95

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		76,266,543.41	-	84,060,234.38	7,793,690.97
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	10,200.00	0.73	12,435.04	2,234.31
	银行间市场	343,526,396.25	3,019,178.08	347,458,178.08	912,603.75
	合计	343,536,596.25	3,019,178.81	347,470,613.12	914,838.06

资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	419,803,139.66	3,019,178.81	431,530,847.50	8,708,529.03

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	56,009.33
其中：交易所市场	47,682.60
银行间市场	8,326.73
应付利息	-
预提费用	66,946.47
合计	122,955.80

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

华宝安睿债券 A

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	371,727,158.96	371,727,158.96
本期申购	342,065,789.15	342,065,789.15
本期赎回（以“-”号填列）	-296,865,217.04	-296,865,217.04
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	416,927,731.07	416,927,731.07

华宝安睿债券 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	4,984.05	4,984.05
本期申购	-	-
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	4,984.05	4,984.05

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

华宝安睿债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	961,951.96	908,796.41	1,870,748.37
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	961,951.96	908,796.41	1,870,748.37
本期利润	3,991,886.19	7,779,924.02	11,771,810.21
本期基金份额交易产生的变动数	643,661.40	95,693.19	739,354.59
其中：基金申购款	2,896,702.94	4,048,396.30	6,945,099.24
基金赎回款	-2,253,041.54	-3,952,703.11	-6,205,744.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,597,499.55	8,784,413.62	14,381,913.17

华宝安睿债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	8.81	12.13	20.94
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	8.81	12.13	20.94
本期利润	46.74	92.75	139.49
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-

其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	55.55	104.88	160.43

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	3,564.56
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	843.64
其他	26.31
合计	4,434.51

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	64,567,825.85
减：卖出股票成本总额	63,496,802.86
减：交易费用	101,682.00
买卖股票差价收入	969,340.99

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	3,576,333.33
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	114,388.31
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	3,690,721.64

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	143,389,351.27

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	140,763,303.75
减：应计利息总额	2,508,883.30
减：交易费用	2,775.91
买卖债券差价收入	114,388.31

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

本基金本报告期内无衍生工具收益。

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	1,000,110.42
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	1,000,110.42

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	7,780,016.77
股票投资	6,799,068.71
债券投资	980,948.06
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	7,780,016.77
----	--------------

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	7,461.55
合计	7,461.55

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	7,439.10
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	9,937.94
账户维护费	9,000.00
合计	85,884.41

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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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

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
当期发生的基金应支付的管理费	1,179,295.17
其中：应支付销售机构的客户维护费	588,369.90
应支付基金管理人的净管理费	590,925.27

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
当期发生的基金应支付的托管费	294,823.76

注：支付基金托管人招商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		
	华宝安睿债券 A	华宝安睿债券 C	合计
华宝基金	-	7.24	7.24

合计	-	7.24	7.24
----	---	------	------

注：销售服务费每日计提，按月支付。A 类基金份额不收取销售服务费，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 0.3% 年费率计提。本基金 C 类基金份额销售服务费计提的计算方法如下： $H=E\times 0.3\%\div \text{当年天数}$ ，H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费，E 为 C 类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

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	879,823.95	3,564.56

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，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

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
123273	三江转债	2026 年 6 月 17 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.01	63	6,300.00	6,300.39	-

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
601369	陕鼓动力	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	9.05	2026 年 7 月 13 日	9.96	24,200	229,732.84	219,010.00	-

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

至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 1,980,089.51 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
220203	22 国开 03	2026 年 7 月 1 日	101.79	22,000	2,239,425.21
合计				22,000	2,239,425.21

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

本基金是一只债券型证券投资基金，属于风险较小、收益稳定的基金品种。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括依法发行上市的股票（含创业板及其他依法发行、上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款等）、国债期货、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。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在控制风险的前提下，追求稳定的当期收益和总回报，争取实现基金资产的长期稳健增值。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司内部监督和反馈系统包括内部控制委员会、督察长、合规审计部、风险管理部、各部门负责人和风险控制联络人、各业务岗位。内部控制委员会负责对公司在经营管理和基金运作中的风险进行评估并研究制订相应的控制制度。督察长向董事会负责，总管公司的内控事务并独立地就内控制度的执行情况履行检查、评价、报告和建议职能。风险管理部在督察长指导下对公司内部控制运行情况进行监控，主要针对公司内部控制制度的总体构架和内部控制的目标进行评估并提出改进意见；合规审计部在督察长的领导下对各部门和岗位的内部控制执行情况进行监督和核查，同时对内控的失控点进行查漏并责令改正。本基金的基金管理人根据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的四层监控防线。第一层监控防线为一线岗位自控与互控；第二层防线为大业务板块内部各部门和部门之间的自控和互控；第三层监控防线为风险管理部和合规审计部对各岗位、各部门、各项业务全面实施的监督反馈；最后是以内部控制委员会为主体的第四层防线，实施对公司各类业务和风险的总体监督、控制，并对风险管理部和合规审计部的工作予以直接指导。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法是通过结合定性分析和定量分析方法，估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具的特征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定相应置信程度和风险损失的限度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%，本基金与由本基金

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	879,823.95	-	-	-	879,823.95
结算备付金	92,065.26	-	-	-	92,065.26
存出保证金	12,340.19	-	-	-	12,340.19
交易性金融资产	50,821,726.03	296,636,452.05	12,435.04	84,060,234.38	431,530,847.50
应收申购款	-	-	-	1,722,658.11	1,722,658.11
资产总计	51,805,955.43	296,636,452.05	12,435.04	85,782,892.49	434,237,735.01
负债					
应付赎回款	-	-	-	565,758.36	565,758.36
应付管理人报酬	-	-	-	203,309.78	203,309.78
应付托管费	-	-	-	50,827.43	50,827.43
卖出回购金融资产款	1,980,089.51	-	-	-	1,980,089.51
应付销售服务费	-	-	-	1.20	1.20
应交税费	-	-	-	4.21	4.21
其他负债	-	-	-	122,955.80	122,955.80
负债总计	1,980,089.51	-	-	942,856.78	2,922,946.29
利率敏感度缺口	49,825,865.92	296,636,452.05	12,435.04	84,840,035.71	431,314,788.72
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	115,945.61	-	-	-	115,945.61
结算备付金	2,271,767.42	-	-	-	2,271,767.42
存出保证金	13,117.38	-	-	-	13,117.38
交易性金融资产	40,433,972.60	255,277,205.49	-	66,545,891.90	362,257,069.99
买入返售金融资产	8,997,802.71	-	-	-	8,997,802.71
应收申购款	-	-	-	199.20	199.20
应收清算款	-	-	-	603,657.31	603,657.31
资产总计	51,832,605.72	255,277,205.49	-	67,149,748.41	374,259,559.62
负债					
应付赎回款	-	-	-	235,983.35	235,983.35
应付管理人报酬	-	-	-	199,916.77	199,916.77
应付托管费	-	-	-	49,979.19	49,979.19
应付清算款	-	-	-	77,172.51	77,172.51
应付销售服务费	-	-	-	1.24	1.24
应交税费	-	-	-	6.82	6.82
其他负债	-	-	-	93,587.42	93,587.42
负债总计	-	-	-	656,647.30	656,647.30
利率敏感度缺口	51,832,605.72	255,277,205.49	-	66,493,101.11	373,602,912.32

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

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	1,909,465.13	1,807,413.77
	市场利率上升 25 个基点	-1,892,344.90	-1,788,425.12

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；投资于股票、可转换债券和可交换债券的比例合计不超过基金资产的 20%；每个交易日日终，扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，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	84,060,234.38	19.49	66,545,891.90	17.81
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	84,060,234.38	19.49	66,545,891.90	17.81

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于报告期末，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

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	83,847,359.03	66,148,641.90
第二层次	347,683,488.47	296,108,428.09
第三层次	—	—

合计	431, 530, 847. 50	362, 257, 069. 99
----	-------------------	-------------------

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	84, 060, 234. 38	19. 36
	其中：股票	84, 060, 234. 38	19. 36
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	347, 470, 613. 12	80. 02
	其中：债券	347, 470, 613. 12	80. 02
	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	971, 889. 21	0. 22
8	其他各项资产	1, 734, 998. 30	0. 40
9	合计	434, 237, 735. 01	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	151,915.80	0.04
B	采矿业	5,838,619.00	1.35
C	制造业	54,588,228.18	12.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	626,721.00	0.15
E	建筑业	205,568.00	0.05
F	批发和零售业	1,048,937.00	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	2,622,203.00	0.61
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,893,495.00	0.67
J	金融业	13,717,886.60	3.18
K	房地产业	169,593.00	0.04
L	租赁和商务服务业	231,736.80	0.05
M	科学研究和技术服务业	1,022,969.00	0.24
N	水利、环境和公共设施管理业	620,158.00	0.14
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	51,125.00	0.01
Q	卫生和社会工作	234,687.00	0.05
R	文化、体育和娱乐业	36,392.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	84,060,234.38	19.49

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	3,500	4,445,000.00	1.03
2	300750	宁德时代	9,100	3,576,391.00	0.83
3	300502	新易盛	5,340	3,241,380.00	0.75
4	002371	北方华创	2,700	2,388,312.00	0.55
5	000333	美的集团	22,000	1,661,660.00	0.39

6	603986	兆易创新	2,000	1,630,000.00	0.38
7	600183	生益科技	9,400	1,629,960.00	0.38
8	300394	天孚通信	4,840	1,464,971.20	0.34
9	601899	紫金矿业	50,700	1,274,598.00	0.30
10	688981	中芯国际	7,900	1,254,678.00	0.29
11	601398	工商银行	162,400	1,148,168.00	0.27
12	601939	建设银行	113,100	1,089,153.00	0.25
13	601628	中国人寿	28,700	1,014,545.00	0.24
14	300274	阳光电源	5,700	906,414.00	0.21
15	601988	中国银行	155,600	890,032.00	0.21
16	603019	中科曙光	8,100	868,563.00	0.20
17	601318	中国平安	17,200	821,128.00	0.19
18	688008	澜起科技	2,600	805,740.00	0.19
19	300408	三环集团	4,300	717,670.00	0.17
20	601919	中远海控	53,500	709,410.00	0.16
21	600096	云天化	23,000	699,200.00	0.16
22	688012	中微公司	1,444	676,514.00	0.16
23	603259	药明康德	5,400	672,354.00	0.16
24	300059	东方财富	31,400	639,932.00	0.15
25	688256	寒武纪	400	638,220.00	0.15
26	688300	联瑞新材	2,600	635,440.00	0.15
27	601077	渝农商行	103,200	630,552.00	0.15
28	002142	宁波银行	20,900	620,521.00	0.14
29	600919	江苏银行	57,400	618,772.00	0.14
30	601088	中国神华	15,700	612,928.00	0.14
31	002966	苏州银行	87,900	611,784.00	0.14
32	601857	中国石油	70,200	609,336.00	0.14
33	600066	宇通客车	22,500	603,225.00	0.14
34	600188	兖矿能源	33,000	586,410.00	0.14
35	603565	中谷物流	59,000	578,790.00	0.13
36	601001	晋控煤业	31,900	554,741.00	0.13
37	601288	农业银行	90,900	551,763.00	0.13
38	601225	陕西煤业	27,100	551,485.00	0.13
39	600938	中国海油	20,000	543,000.00	0.13
40	002126	银轮股份	10,600	527,880.00	0.12
41	002475	立讯精密	7,300	513,920.00	0.12
42	601138	工业富联	7,100	512,265.00	0.12
43	000429	粤高速 A	36,800	502,320.00	0.12
44	600030	中信证券	17,300	497,029.00	0.12
45	600989	宝丰能源	23,900	485,887.00	0.11
46	601100	恒立液压	4,500	484,020.00	0.11
47	603699	纽威股份	9,600	482,880.00	0.11
48	600901	江苏金租	82,700	475,525.00	0.11

49	000895	双汇发展	21,100	472,640.00	0.11
50	601665	齐鲁银行	81,200	468,524.00	0.11
51	301308	江波龙	600	422,280.00	0.10
52	002895	川恒股份	14,200	414,640.00	0.10
53	300395	菲利华	3,100	414,563.00	0.10
54	002463	沪电股份	2,700	412,560.00	0.10
55	601009	南京银行	40,900	404,501.00	0.09
56	300857	协创数据	1,140	387,486.00	0.09
57	600750	华润江中	17,300	381,811.00	0.09
58	601898	中煤能源	31,300	381,234.00	0.09
59	600031	三一重工	21,800	376,704.00	0.09
60	300604	长川科技	1,100	375,562.00	0.09
61	688041	海光信息	1,000	370,300.00	0.09
62	600926	杭州银行	25,500	368,475.00	0.09
63	600900	长江电力	13,700	362,639.00	0.08
64	300475	香农芯创	1,200	360,000.00	0.08
65	000157	中联重科	51,600	359,652.00	0.08
66	000933	神火股份	16,900	358,280.00	0.08
67	601998	中信银行	51,100	354,123.00	0.08
68	601000	唐山港	85,100	353,165.00	0.08
69	600323	瀚蓝环境	12,800	351,488.00	0.08
70	300476	胜宏科技	1,000	346,430.00	0.08
71	002233	塔牌集团	48,800	340,136.00	0.08
72	600350	山东高速	29,400	327,222.00	0.08
73	002884	凌霄泵业	21,400	326,136.00	0.08
74	300014	亿纬锂能	5,000	325,150.00	0.08
75	300223	北京君正	1,300	323,570.00	0.08
76	600282	南钢股份	70,200	322,218.00	0.07
77	300124	汇川技术	4,800	318,384.00	0.07
78	002001	新 和 成	10,800	306,936.00	0.07
79	600177	雅戈尔	40,600	305,718.00	0.07
80	603659	璞泰来	10,500	303,765.00	0.07
81	002807	江阴银行	81,860	303,700.60	0.07
82	601328	交通银行	47,100	302,853.00	0.07
83	601688	华泰证券	14,100	290,742.00	0.07
84	600958	东方证券	30,500	287,920.00	0.07
85	300442	润泽科技	3,400	282,438.00	0.07
86	002043	兔 宝 宝	24,900	275,892.00	0.06
87	600276	恒瑞医药	5,200	270,608.00	0.06
88	002460	赣锋锂业	4,100	268,140.00	0.06
89	000975	山金国际	15,500	263,500.00	0.06
90	000672	上峰材料	11,100	262,848.00	0.06
91	601229	上海银行	29,900	259,532.00	0.06

92	600176	中国巨石	3,500	255,080.00	0.06
93	300373	扬杰科技	1,600	251,568.00	0.06
94	300033	同花顺	1,040	250,640.00	0.06
95	000831	中国稀土	4,500	249,705.00	0.06
96	601689	拓普集团	4,400	248,248.00	0.06
97	002050	三花智控	5,200	227,916.00	0.05
98	300054	鼎龙股份	2,100	222,537.00	0.05
99	601963	重庆银行	21,800	219,744.00	0.05
100	688187	时代电气	3,200	219,712.00	0.05
101	601369	陕鼓动力	24,200	219,010.00	0.05
102	000807	云铝股份	9,500	210,330.00	0.05
103	301536	星宸科技	1,600	205,936.00	0.05
104	301358	湖南裕能	2,600	197,262.00	0.05
105	600295	鄂尔多斯	18,400	197,248.00	0.05
106	603799	华友钴业	4,000	193,040.00	0.04
107	000977	浪潮信息	2,700	189,000.00	0.04
108	603606	东方电缆	4,540	188,455.40	0.04
109	601877	正泰电器	7,500	188,025.00	0.04
110	600879	航天电子	8,800	187,352.00	0.04
111	300613	富瀚微	2,300	184,184.00	0.04
112	300438	鹏辉能源	2,200	182,270.00	0.04
113	600941	中国移动	2,100	180,873.00	0.04
114	603993	洛阳钼业	10,300	180,765.00	0.04
115	300458	全志科技	4,520	178,359.20	0.04
116	300433	蓝思科技	3,300	177,078.00	0.04
117	002555	三七互娱	9,100	171,717.00	0.04
118	301377	鼎泰高科	300	165,270.00	0.04
119	002128	电投能源	7,100	164,152.00	0.04
120	300861	美畅股份	6,500	163,735.00	0.04
121	300919	中伟新材	3,700	161,875.00	0.04
122	600760	中航沈飞	3,900	160,290.00	0.04
123	002533	金杯电工	14,600	155,782.00	0.04
124	002028	思源电气	900	155,700.00	0.04
125	600584	长电科技	1,500	155,325.00	0.04
126	601995	中金公司	4,200	151,830.00	0.04
127	002594	比亚迪	1,900	151,430.00	0.04
128	600012	皖通高速	9,600	151,296.00	0.04
129	600346	恒力石化	8,400	148,764.00	0.03
130	300277	汽轮科技	9,800	147,392.00	0.03
131	000100	TCL 科技	25,300	147,246.00	0.03
132	300236	上海新阳	1,100	144,650.00	0.03
133	000830	鲁西化工	12,000	144,000.00	0.03
134	600741	华域汽车	9,200	142,784.00	0.03

135	300953	震裕科技	1,060	141,722.00	0.03
136	300972	万辰集团	800	138,728.00	0.03
137	603337	杰克科技	3,800	137,674.00	0.03
138	002916	深南电路	300	137,370.00	0.03
139	002244	滨江集团	18,000	136,800.00	0.03
140	600999	招商证券	6,400	135,040.00	0.03
141	300390	天华新能	1,400	130,914.00	0.03
142	300496	中科创达	2,100	129,759.00	0.03
143	300434	金石亚药	11,400	128,022.00	0.03
144	603706	东方环宇	7,400	127,946.00	0.03
145	601600	中国铝业	15,300	125,766.00	0.03
146	301275	汉朔科技	2,800	125,720.00	0.03
147	300073	当升科技	2,600	124,904.00	0.03
148	300590	移为通信	8,700	124,845.00	0.03
149	600089	特变电工	5,400	121,500.00	0.03
150	000938	紫光股份	4,200	121,212.00	0.03
151	300037	新宙邦	1,300	120,705.00	0.03
152	301662	宏工科技	1,180	119,557.60	0.03
153	600519	贵州茅台	100	118,549.00	0.03
154	000425	徐工机械	14,600	118,114.00	0.03
155	605599	菜百股份	8,500	116,450.00	0.03
156	301345	涛涛车业	500	115,500.00	0.03
157	301055	张小泉	2,700	114,669.00	0.03
158	301371	敷尔佳	4,400	114,400.00	0.03
159	002230	科大讯飞	2,800	114,352.00	0.03
160	301219	腾远钴业	2,060	112,888.00	0.03
161	301122	采纳股份	3,800	111,758.00	0.03
162	300738	奥飞数据	5,500	111,210.00	0.03
163	300823	建科智能	7,500	109,350.00	0.03
164	600660	福耀玻璃	2,100	105,924.00	0.02
165	300398	飞凯材料	1,700	104,975.00	0.02
166	300801	泰和科技	3,200	103,360.00	0.02
167	300628	亿联网络	3,000	101,460.00	0.02
168	301150	中一科技	1,600	100,976.00	0.02
169	601377	兴业证券	16,700	100,868.00	0.02
170	300015	爱尔眼科	12,200	100,772.00	0.02
171	300002	神州泰岳	12,900	100,749.00	0.02
172	301665	泰禾股份	4,800	100,608.00	0.02
173	688525	佰维存储	200	98,946.00	0.02
174	601117	中国化学	13,400	98,490.00	0.02
175	301239	普瑞眼科	3,200	97,440.00	0.02
176	300012	华测检测	7,000	97,020.00	0.02
177	301500	飞南资源	3,700	96,385.00	0.02

178	601636	旗滨集团	9,400	96,162.00	0.02
179	000708	中信特钢	7,600	95,912.00	0.02
180	301101	明月镜片	3,500	95,340.00	0.02
181	300760	迈瑞医疗	700	95,081.00	0.02
182	300034	钢研高纳	5,500	94,270.00	0.02
183	300789	唐源电气	5,300	94,181.00	0.02
184	301031	中熔电气	784	93,648.80	0.02
185	600153	建发股份	11,800	93,574.00	0.02
186	300512	中亚股份	13,600	92,752.00	0.02
187	301606	绿联科技	1,500	91,530.00	0.02
188	600642	申能股份	10,400	90,792.00	0.02
189	301116	益客食品	10,600	90,736.00	0.02
190	000338	潍柴动力	3,300	89,925.00	0.02
191	300865	大宏立	4,100	89,585.00	0.02
192	300428	立中集团	4,900	89,082.00	0.02
193	300832	新产业	2,100	88,200.00	0.02
194	600362	江西铜业	2,000	86,600.00	0.02
195	301608	博实结	1,690	84,939.40	0.02
196	300008	天海防务	14,000	84,840.00	0.02
197	002938	鹏鼎控股	800	84,304.00	0.02
198	301015	百洋医药	4,400	83,864.00	0.02
199	300042	朗科科技	1,100	83,787.00	0.02
200	300866	安克创新	800	83,600.00	0.02
201	300548	长芯博创	300	83,400.00	0.02
202	600546	山煤国际	7,600	83,068.00	0.02
203	300681	英搏尔	2,900	82,998.00	0.02
204	300768	迪普科技	6,000	82,620.00	0.02
205	300302	同有科技	1,600	81,872.00	0.02
206	301060	兰卫医学	9,900	80,883.00	0.02
207	301048	金鹰重工	9,300	80,073.00	0.02
208	301339	通行宝	7,800	79,794.00	0.02
209	300323	华灿光电	3,900	79,560.00	0.02
210	300511	雪榕生物	15,600	78,468.00	0.02
211	601319	中国人保	11,600	78,416.00	0.02
212	300388	节能国祯	12,300	75,891.00	0.02
213	688697	纽威数控	5,562	75,587.58	0.02
214	300445	康斯特	3,600	74,952.00	0.02
215	300822	贝仕达克	6,400	74,880.00	0.02
216	300596	利安隆	1,400	73,472.00	0.02
217	300803	指南针	800	73,336.00	0.02
218	600406	国电南瑞	3,200	73,120.00	0.02
219	301019	宁波色母	4,100	73,103.00	0.02
220	300743	天地数码	5,000	72,950.00	0.02

221	300422	博世科	17,200	72,412.00	0.02
222	301200	大族数控	200	72,130.00	0.02
223	002416	爱施德	8,000	71,680.00	0.02
224	600713	南京医药	14,000	70,000.00	0.02
225	300406	九强生物	6,400	69,952.00	0.02
226	300500	启迪设计	7,900	69,757.00	0.02
227	300662	科锐国际	4,100	69,618.00	0.02
228	601668	中国建筑	15,700	68,138.00	0.02
229	002293	罗莱生活	6,600	65,274.00	0.02
230	301032	新柴股份	6,900	64,170.00	0.01
231	300693	盛弘股份	1,300	63,375.00	0.01
232	301156	美农生物	5,800	63,046.00	0.01
233	300424	航新科技	4,000	62,960.00	0.01
234	300489	光智科技	200	62,390.00	0.01
235	601339	百隆东方	9,000	60,930.00	0.01
236	301085	亚康股份	1,000	60,610.00	0.01
237	601187	厦门银行	8,600	58,738.00	0.01
238	300970	华绿生物	3,210	58,678.80	0.01
239	300187	永清环保	11,500	58,075.00	0.01
240	300184	力源信息	3,300	57,915.00	0.01
241	301535	浙江华远	4,300	57,706.00	0.01
242	300030	阳普医疗	9,800	56,938.00	0.01
243	002532	天山铝业	5,300	56,869.00	0.01
244	301260	格力博	4,200	56,742.00	0.01
245	301600	慧翰股份	600	54,840.00	0.01
246	300769	德方纳米	800	53,200.00	0.01
247	300450	先导智能	1,300	52,936.00	0.01
248	300509	新美星	6,300	52,794.00	0.01
249	600887	伊利股份	2,200	52,712.00	0.01
250	300206	理邦仪器	4,300	52,589.00	0.01
251	603558	健盛集团	4,700	52,123.00	0.01
252	002493	荣盛石化	4,800	51,600.00	0.01
253	300933	中辰股份	8,400	51,072.00	0.01
254	300270	中威电子	3,900	50,739.00	0.01
255	301292	海科新源	600	47,838.00	0.01
256	600933	爱柯迪	3,200	47,296.00	0.01
257	300226	上海钢联	3,080	47,154.80	0.01
258	300154	瑞凌股份	6,100	45,872.00	0.01
259	600674	川投能源	3,200	45,344.00	0.01
260	300153	科泰电源	2,000	45,240.00	0.01
261	301215	中汽股份	8,600	44,634.00	0.01
262	301548	崇德科技	500	44,385.00	0.01
263	301043	绿岛风	900	44,199.00	0.01

264	600426	华鲁恒升	1,800	43,056.00	0.01
265	688111	金山办公	200	42,610.00	0.01
266	301510	固高科技	1,300	41,509.00	0.01
267	301559	中集环科	3,400	41,446.00	0.01
268	300797	钢研纳克	3,100	41,106.00	0.01
269	300490	华自科技	3,100	41,013.00	0.01
270	301246	宏源药业	1,500	40,350.00	0.01
271	300867	圣元环保	2,200	39,864.00	0.01
272	002061	浙江交科	11,800	38,940.00	0.01
273	600050	中国联通	9,700	38,800.00	0.01
274	300564	筑博设计	3,200	38,432.00	0.01
275	300771	智莱科技	3,700	38,184.00	0.01
276	600875	东方电气	1,300	37,401.00	0.01
277	300699	光威复材	1,300	37,245.00	0.01
278	300043	星辉娱乐	8,400	36,540.00	0.01
279	301267	华夏眼科	2,500	36,475.00	0.01
280	300487	蓝晓科技	600	35,310.00	0.01
281	300988	津荣天宇	2,200	34,386.00	0.01
282	301266	宇邦新材	1,500	34,260.00	0.01
283	002517	恺英网络	2,100	34,125.00	0.01
284	300483	首华燃气	1,900	33,402.00	0.01
285	301087	可孚医疗	700	33,355.00	0.01
286	301059	金三江	3,000	33,270.00	0.01
287	301217	铜冠铜箔	200	33,014.00	0.01
288	001979	招商蛇口	5,100	32,793.00	0.01
289	301329	信音电子	1,300	31,577.00	0.01
290	301261	恒工精密	400	31,240.00	0.01
291	300405	科隆股份	6,000	31,080.00	0.01
292	301297	富乐德	500	30,620.00	0.01
293	301222	浙江恒威	1,000	29,960.00	0.01
294	301589	诺瓦星云	200	29,796.00	0.01
295	300556	丝路视觉	1,700	29,529.00	0.01
296	301392	汇成真空	100	28,864.00	0.01
297	300583	赛托生物	2,500	28,075.00	0.01
298	300999	金龙鱼	1,200	27,912.00	0.01
299	300503	昊志机电	300	27,690.00	0.01
300	600570	恒生电子	1,300	27,547.00	0.01
301	605098	行动教育	500	27,080.00	0.01
302	300727	润禾材料	700	26,194.00	0.01
303	600372	中航机载	2,400	26,040.00	0.01
304	300067	安诺其	4,800	26,016.00	0.01
305	300142	沃森生物	2,000	25,980.00	0.01
306	300357	我武生物	1,100	25,652.00	0.01

307	300684	中石科技	400	24,400.00	0.01
308	300971	博亚精工	1,300	24,258.00	0.01
309	300492	华图山鼎	700	24,045.00	0.01
309	301190	善水科技	1,500	24,045.00	0.01
311	300113	顺网科技	1,300	23,673.00	0.01
312	300945	曼卡龙	2,100	22,743.00	0.01
313	301109	军信股份	1,800	22,428.00	0.01
314	300723	一品红	600	22,368.00	0.01
315	300307	慈星股份	3,000	22,110.00	0.01
316	301321	翰博高新	500	22,075.00	0.01
317	300629	新劲刚	1,000	21,460.00	0.00
318	300233	金城医药	1,700	21,080.00	0.00
319	300504	天邑股份	1,300	20,969.00	0.00
320	301097	天益医疗	580	20,706.00	0.00
321	300975	商络电子	400	20,700.00	0.00
322	301216	万凯新材	900	20,691.00	0.00
323	000768	中航西飞	1,000	20,480.00	0.00
324	300674	宇信科技	1,300	19,565.00	0.00
325	301025	读客文化	2,500	19,400.00	0.00
326	300454	深信服	200	19,240.00	0.00
327	301273	瑞晨环保	600	18,906.00	0.00
328	300141	和顺电气	2,000	18,780.00	0.00
329	301136	招标股份	1,700	18,666.00	0.00
330	300346	南大光电	200	18,530.00	0.00
331	301083	百胜智能	1,400	18,438.00	0.00
332	300785	值得买	500	18,335.00	0.00
333	301268	铭利达	1,300	18,174.00	0.00
334	300625	三雄极光	2,000	18,160.00	0.00
335	301100	风光股份	1,300	18,070.00	0.00
336	300155	安居宝	4,600	18,032.00	0.00
337	300575	中旗股份	3,600	17,712.00	0.00
338	301408	华人健康	1,200	17,256.00	0.00
339	300701	森霸传感	1,800	17,226.00	0.00
340	300773	拉卡拉	1,120	17,136.00	0.00
341	300133	华策影视	2,400	16,992.00	0.00
342	300281	金明精机	2,800	16,884.00	0.00
343	301189	奥尼电子	280	16,500.40	0.00
344	300607	拓斯达	400	16,492.00	0.00
345	300658	延江股份	1,400	16,002.00	0.00
346	300573	兴齐眼药	390	15,896.40	0.00
347	300957	贝泰妮	500	15,755.00	0.00
348	300380	安硕信息	500	15,385.00	0.00
349	300482	万孚生物	900	14,949.00	0.00

350	605117	德业股份	140	14,865.20	0.00
351	300761	立华股份	900	14,769.00	0.00
352	300283	温州宏丰	700	14,385.00	0.00
353	300824	北鼎股份	2,000	14,360.00	0.00
354	300661	圣邦股份	100	14,348.00	0.00
355	601012	隆基绿能	1,000	13,120.00	0.00
356	300795	米奥会展	1,500	12,840.00	0.00
357	300770	新媒股份	400	12,596.00	0.00
358	301429	森泰股份	700	10,969.00	0.00
359	301256	华融化学	800	10,368.00	0.00
360	300381	溢多利	1,600	8,992.00	0.00
361	300650	太龙股份	600	8,718.00	0.00
362	301102	兆讯传媒	1,000	8,550.00	0.00
363	301165	锐捷网络	100	8,045.00	0.00
364	300358	楚天科技	1,000	8,000.00	0.00
365	300515	三德科技	600	7,830.00	0.00
366	300306	远方信息	800	7,760.00	0.00
367	300466	赛摩智能	1,100	7,744.00	0.00
368	301110	青木科技	200	7,572.00	0.00
369	301283	聚胶股份	300	7,344.00	0.00
370	300459	汤姆猫	2,000	6,780.00	0.00
371	300320	海达股份	700	6,678.00	0.00
372	300407	凯发电气	600	6,480.00	0.00
373	300253	卫宁健康	900	6,057.00	0.00
374	300432	富临精工	300	6,027.00	0.00
375	300284	苏交科	1,200	6,000.00	0.00
376	301213	观想科技	100	4,914.00	0.00
377	301028	鼎熔岩	300	4,788.00	0.00
378	300387	富邦科技	700	4,753.00	0.00
379	300839	博汇股份	400	4,684.00	0.00
380	300404	博济医药	500	4,380.00	0.00
381	300415	伊之密	200	3,982.00	0.00
382	301056	森赫股份	300	3,360.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	1,848,556.00	0.49
2	300308	中际旭创	1,218,472.00	0.33
3	300394	天孚通信	823,950.00	0.22
4	300502	新易盛	815,013.20	0.22
5	000333	美的集团	750,058.00	0.20
6	601919	中远海控	671,356.00	0.18

7	601899	紫金矿业	636,971.00	0.17
8	002371	北方华创	636,551.00	0.17
9	601628	中国人寿	608,659.00	0.16
10	688256	寒武纪	574,060.00	0.15
11	601318	中国平安	520,173.00	0.14
12	300433	蓝思科技	489,085.00	0.13
13	300274	阳光电源	487,677.00	0.13
14	301308	江波龙	464,882.00	0.12
15	300408	三环集团	463,164.00	0.12
16	300395	菲利华	462,237.00	0.12
17	300476	胜宏科技	443,483.00	0.12
18	688981	中芯国际	425,174.00	0.11
19	300014	亿纬锂能	423,216.00	0.11
20	601398	工商银行	413,332.00	0.11

注：买入金额不包括相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	1,358,335.00	0.36
2	300308	中际旭创	1,136,255.00	0.30
3	600519	贵州茅台	674,053.47	0.18
4	300274	阳光电源	503,295.00	0.13
5	002027	分众传媒	501,397.00	0.13
6	600941	中国移动	495,599.00	0.13
7	601319	中国人保	486,713.00	0.13
8	601211	国泰海通	477,068.00	0.13
9	300433	蓝思科技	468,259.00	0.13
10	300502	新易盛	448,768.00	0.12
11	600030	中信证券	422,219.00	0.11
12	000932	华菱钢铁	413,142.00	0.11
13	300001	特锐德	401,673.00	0.11
14	300442	润泽科技	397,236.00	0.11
15	300760	迈瑞医疗	369,837.00	0.10
16	301308	江波龙	363,552.00	0.10
17	300802	矩子科技	356,964.00	0.10
18	300394	天孚通信	345,168.00	0.09
19	300407	凯发电气	335,944.00	0.09
20	300476	胜宏科技	323,812.00	0.09

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	74,212,076.63
--------------	---------------

卖出股票收入（成交）总额	64,567,825.85
--------------	---------------

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	347,458,178.08	80.56
	其中：政策性金融债	347,458,178.08	80.56
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	12,435.04	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	347,470,613.12	80.56

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	230203	23 国开 03	500,000	51,664,493.15	11.98
2	240208	24 国开 08	500,000	51,486,712.33	11.94
3	230208	23 国开 08	500,000	51,182,726.03	11.87
4	250423	25 农发 23	500,000	50,938,397.26	11.81
5	250208	25 国开 08	500,000	50,122,972.60	11.62

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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

7.10.2 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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

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

华宝安睿债券截止 2026 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 中国农业发展银行因信贷资金投向不合规、贷后管理不到位等; 于 2025 年 08 月 01 日收到金融监管总局罚款的处罚措施。

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

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和分析, 认为上述处分不会对公司的投资价值构成实质性影响, 因此本基金管理人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。

7.11.2 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。

7.11.3 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	12,340.19
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,722,658.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,734,998.30

7.11.4 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。

7.11.5 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。

7.11.6 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 (%)
华宝安睿 债券 A	2,274	183,345.53	1,991,078.77	0.48	414,936,652.30	99.52
华宝安睿 债券 C	1	4,984.05	0.00	0.00	4,984.05	100.00
合计	2,275	183,267.13	1,991,078.77	0.48	414,941,636.35	99.52

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例 （%）
基金管 理人所有从业 人员持有本基 金	华宝安睿债券 A	0.00	0.0000
	华宝安睿债券 C	4,984.05	100.0000
	合计	4,984.05	0.0012

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人 员、基金投资和研 究部门负责人持有本开 放式基金	华宝安睿债券 A	0
	华宝安睿债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有 本开放式基金	华宝安睿债券 A	0
	华宝安睿债券 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华宝安睿债券 A	华宝安睿债券 C
基金合同生效日 (2025 年 9 月 19 日) 基金份额总额	409,891,929.02	5,000.10
本报告期期初基金 份额总额	371,727,158.96	4,984.05
本报告期基金总申 购份额	342,065,789.15	—
减：本报告期基金 总赎回份额	296,865,217.04	—
本报告期基金拆分 变动份额	—	—
本报告期期末基金 份额总额	416,927,731.07	4,984.05

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产和基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：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，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

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，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信证券	1	107,774,338.34	77.66	46,983.02	77.66	-
中金国际	1	31,005,564.14	22.34	13,515.69	22.34	-

注：1. 基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

（1）选择标准: 资力雄厚，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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券	成交金额	占当期债券回购成交总	成交金额	占当期权证

		成交总额 的比例 (%)		额的比例 (%)		成交总 额的比例 (%)
中信证券	8,438.08	37.11	-	-	-	-
中金国际	14,301.00	62.89	72,354,000.00	100.00	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华宝基金关于旗下部分基金新增万和证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2026-01-16
2	华宝安睿债券型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2026-01-22
3	华宝基金关于旗下部分基金新增宁波银行同业易管家平台为代销机构的公告	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	2026-02-04
4	华宝基金关于华宝安睿债券型证券投资基金 A 类份额参与招商银行费率优惠活动的公告	基金管理人网站, 上海证券报	2026-03-16
5	华宝安睿债券型证券投资基金 2025 年年度报告	基金管理人网站	2026-03-31
6	华宝基金关于旗下部分基金新增中国人寿保险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	2026-04-03
7	华宝安睿债券型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2026-04-22
8	华宝基金关于华宝安睿债券型证券投资基金新增代销机构的通知	基金管理人网站	2026-05-20
9	华宝基金关于旗下部分基金新增北京济安基金销售有限公司为代销机构的通知	基金管理人网站	2026-05-20
10	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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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；
华宝安睿债券型证券投资基金基金合同；
华宝安睿债券型证券投资基金招募说明书；
华宝安睿债券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