

# 华宝远识混合型证券投资基金

## 2025 年中期报告

2025 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：2025 年 8 月 29 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规定，于 2025 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 2025 年 03 月 18 日（基金合同生效日）起至 2025 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	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遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
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	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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的真实、准确和完整发表意见	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
<b>§ 7 投资组合报告</b>	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	51
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	51
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	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 .....	52
7.12 投资组合报告附注 .....	52
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>53</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	53
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 .....	54
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>54</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>55</b>
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 .....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	55
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	55
10.8 其他重大事件 .....	56
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>57</b>
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 .....	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	58
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>58</b>
12.1 备查文件目录 .....	58
12.2 存放地点 .....	58
12.3 查阅方式 .....	58

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华宝远识混合型证券投资基金	
基金简称	华宝远识混合	
基金主代码	022864	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 3 月 18 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	16,156,207.23 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华宝远识混合 A	华宝远识混合 C
下属分级基金的交易代码	022864	022865
报告期末下属分级基金的份额总额	8,102,028.98 份	8,054,178.25 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在控制风险的前提下，充分发挥专业能力，力争组合资产实现长期稳健的增值。
投资策略	本基金采取积极的大类资产配置策略，通过宏观策略研究，综合考虑宏观经济、国家财政政策、货币政策、产业政策以及市场流动性等方面的因素，对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪，决定大类资产配置比例。本基金将采取“自上而下”和“自下而上”相结合的投资策略，深入分析公司的基本面和业务前景，综合判断上市公司的投资价值，构建投资组合。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×65%+中证综合债指数收益率×20%+恒生指数（人民币）收益率×15%。
风险收益特征	本基金是一只主动投资的混合型基金，理论上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。本基金可通过港股通机制投资港股通标的股票，还可能面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华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
	联系电话	021-38505888
	电子邮箱	xxpl@fsfund.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	黄孔威	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	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www. ffsfund. com
基金中期报告备置地点	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	2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日） - 2025 年 6 月 30 日	
	华宝远识混合 A	华宝远识混合 C
本期已实现收益	493,971.92	646,007.35
本期利润	549,584.23	994,600.98
加权平均基金份额本期利润	0.0320	0.0127
本期加权平均净值利润率	3.17%	1.27%
本期基金份额净值增长率	3.81%	3.61%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	

期末可供分配利润	308,565.75	290,721.67
期末可供分配基金份额利润	0.0381	0.0361
期末基金资产净值	8,410,594.73	8,344,899.92
期末基金份额净值	1.0381	1.0361
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	3.81%	3.61%

- 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。
5. 本基金合同在当期生效。

### 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

华宝远识混合 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
过去一个月	0.89%	0.42%	2.47%	0.53%	-1.58%	-0.11%
过去三个月	3.70%	0.36%	1.70%	1.05%	2.00%	-0.69%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	3.81%	0.33%	-0.90%	1.00%	4.71%	-0.67%

华宝远识混合 C

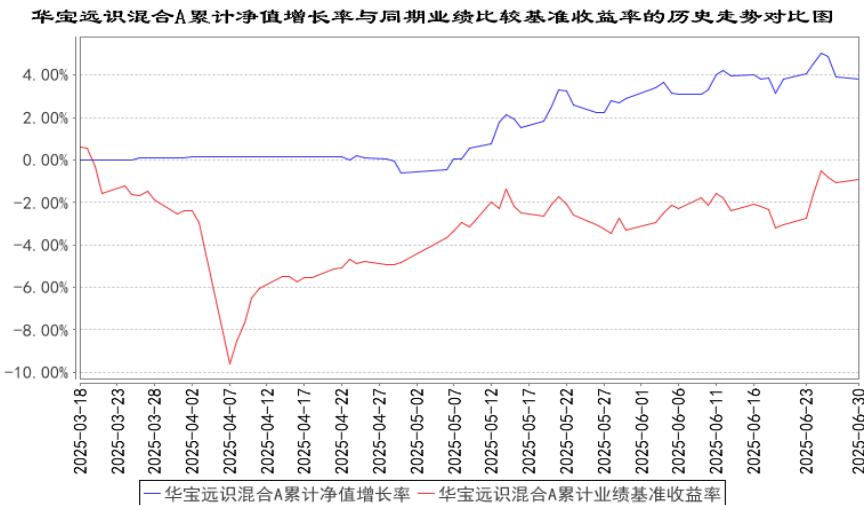
阶段	份额净值增长 率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.84%	0.42%	2.47%	0.53%	-1.63%	-0.11%
过去三个月	3.52%	0.36%	1.70%	1.05%	1.82%	-0.69%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同 生效起至今	3.61%	0.33%	-0.90%	1.00%	4.51%	-0.67%

注：（1）基金业绩基准：中证 800 指数收益率×65%+中证综合债指数收益率×20%+恒生指数（人民币）收益率×15%。;

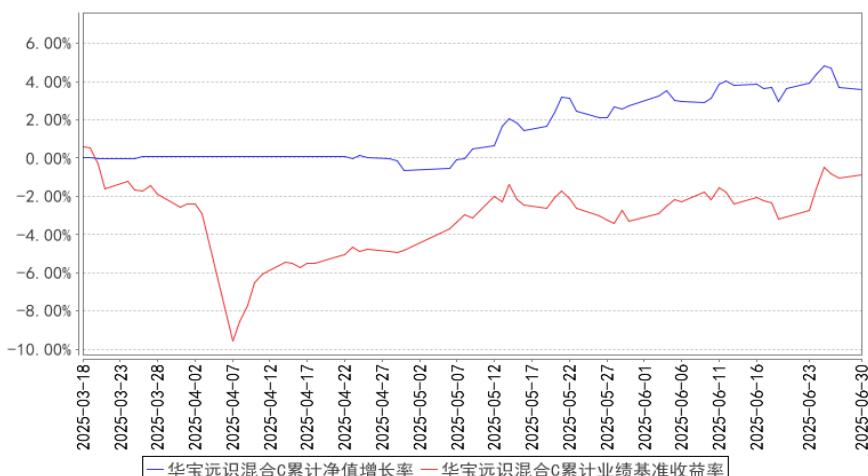
（2）净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）；

（3）本基金成立于 2025 年 03 月 18 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



华宝远识混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同生效于 2025 年 03 月 18 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，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期。

## § 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（2025 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 153 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	2025-03- 18	-	10 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 月起任华宝远识混合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》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》及其各项实施细则、《华宝远识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 1 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

2025 年上半年权益资产总体表现企稳修复，一季度 TMT 受到行业催化表现较好，4 月份权益市场受到关税战的影响，出现短期调整后逐渐回补，整体仍然呈现上行的趋势，流动性和主题活跃度持续居于高位。风格方面，沪深 300、中证 500、中证 1000、中证 2000 分别上涨 0.03%、3.31%、6.69%、15.24%，微盘股指数大涨 43.29%，小盘显著强于大盘，流动性的推升显著强于去年。行业方面，成长板块内部资金轮动快速，同时高股息板块的银行股表现居前，传统消费及周期品板块总体偏弱。

华宝远识混合基金成立于 2025 年 3 月中下旬，报告期内根据市场的波动情况逐步完成基金建仓，目前基金整体仓位已符合相应的合同要求，进入平稳运作阶段。基金的整体配置仍偏向于价值，重视股票基本面的可跟踪、可验证性和估值的明确匹配；长期中将对标权益资产的业绩比较基准，争取相对业绩基准的长期超额表现。

##### 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 3.81%，本报告期基金份额 C 类净值增长率为 3.61%；同期业绩比较基准收益率为-0.90%。

#### 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 2025 下半年，预计总量经济仍将在波动中前行。全球经济复苏进行中，同时也面临通胀压力和政策调整的挑战，但主要经济体政策支持仍可能推动增长。证券市场受市场情绪和资金流动影响，估值的抬升将在高点处带来波动的放大，结构性机会或存在于具备边际变化的板块，同时，具备较高基本面质量和稳定性的优质公司仍然是权益资产配置的底仓核心配置品种。截至二季度末，沪深 300、中证 500、中证 1000 指数的市盈率分别为 13.07、28.88、38.95 倍，分别处于各自过去十年 65.57%、67.46%、54.98%的历史分位数；微盘股市盈率转负，依赖于流动性的支撑；科创 50 指数市盈率 136 倍，等待市场再度进入财报季后观察业绩的阶段性亮点的确认，市场在度过估值的快速底部修复阶段之后，也会面临阶段性的轮动和估值的动态变化，真正能够在长期中创造价值、具备较高的技术质量或现金流质量的公司将最终成为市场消化估值和长期创造收

益的基础。

远识混合基金定位为价值策略产品，对于估值匹配度和盈利确定性的要求相对较为明确。在当前低利率的市场环境下，具有较高股息率水平、良好的基本面稳定性和现金回流能力的上市公司承载了除固收资产以外重要的资产配置功能。截至 2025 年二季度末，中证红利指数市盈率 8.07 倍，市净率 0.80 倍，年度层面股息率仍在 5% 以上，在各宽基基准中依然是估值相对最为明确、可测算的长期配置板块。收益特征方面，2025 年价值指数的整体涨速在各风格中不快，属于稳中有进的实现风格，但总体仍保持了在较低的波动率水平下、较为稳定的绝对收益实现结果，年化波动率和最大回撤均相对可控的特征延续。预期下半年基金仍将延续稳定的策略框架，观察财报数据更新后各基本面指标的边际变化，在保持对边际信息的跟踪的同时，控制组合的总体估值作为风格偏离的总体约束，争取相对业绩基准的长期超额表现。

#### 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

本基金本报告期未进行利润分配，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：华宝远识混合型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日
<b>资产：</b>		
货币资金	6. 4. 7. 1	324,523.33
结算备付金		246,794.09
存出保证金		—
交易性金融资产	6. 4. 7. 2	16,787,239.37
其中：股票投资		15,875,804.19
基金投资		—
债券投资		911,435.18
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		52, 937. 07
应收股利		62, 915. 34
应收申购款		48, 339. 73
递延所得税资产		-
其他资产	6. 4. 7. 5	-
资产总计		17, 522, 748. 93
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025 年 6 月 30 日</b>
<b>负债：</b>		
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		-
应付赎回款		688, 459. 76
应付管理人报酬		19, 301. 96
应付托管费		3, 216. 98
应付销售服务费		4, 801. 38
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6. 4. 7. 6	51, 474. 20
负债合计		767, 254. 28
<b>净资产：</b>		
实收基金	6. 4. 7. 7	16, 156, 207. 23
其他综合收益		-
未分配利润	6. 4. 7. 8	599, 287. 42
净资产合计		16, 755, 494. 65
负债和净资产总计		17, 522, 748. 93

注：1. 本基金合同生效日为 2025 年 03 月 18 日，本报告期自基金合同生效日 2025 年 03 月 18 日起至 2025 年 06 月 30 日止。

2. 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 16, 156, 207. 23 份，其中华宝远识混合 A 基金份额总额 8, 102, 028. 98 份，基金份额净值 1. 0381 元；华宝远识混合 C 基金份额总额 8, 054, 178. 25 份，基金份额净值 1. 0361 元。

## 6.2 利润表

会计主体：华宝远识混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 3 月 18 日（基金合 同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
<b>一、营业收入</b>		2,094,634.47
1. 利息收入		309,662.68
其中：存款利息收入	6. 4. 7. 9	191,872.18
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		117,790.50
其他利息收入		—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,035,926.56
其中：股票投资收益	6. 4. 7. 10	558,640.20
基金投资收益		—
债券投资收益	6. 4. 7. 11	1,511.80
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	475,774.56
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	404,205.94
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	344,839.29
<b>减：二、营业总支出</b>		550,449.26
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	314,990.58
其中：暂估管理人报酬		—
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	52,498.35
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	128,515.03
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		4.69
8. 其他费用	6. 4. 7. 19	54,440.61

三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		1,544,185.21
减：所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		1,544,185.21
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		1,544,185.21

注：本产品成立于 2025 年 03 月 18 日，故无上年度可比期间。

### 6.3 净资产变动表

会计主体：华宝远识混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期				
	2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）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	-	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
二、本期期初净资产	236,910,570.82	-	-	-	236,910,570.82
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	- 220,754,363.59	-	- 599,287.42	- -220,155,076.17	
(一)、综合收益总额	-	-	1,544,185.21	1,544,185.21	
(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)	- 220,754,363.59	-	-944,897.79	-221,699,261.38	
其中：1.基金申购款	1,532,194.23	-	41,231.12	1,573,425.35	
2.基金赎回款	- 222,286,557.82	-	-986,128.91	-223,272,686.73	
(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	16,156,207.23	-	599,287.42	16,755,494.65

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

李孟恒

张幸骏

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华宝远识混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系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[2023]1213 号文《关于准予华宝远识混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，由华宝基金管理有限公司 2024 年 12 月 16 日至 2025 年 3 月 14 日止期间向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2025）验字第 70072895\_B07 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2025 年 3 月 18 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 236,885,029.23 元，其中 A 类基金份额的净认购金额为人民币 33,554,089.32 元；C 类基金份额的净认购金额为人民币 203,330,939.91 元。在募集期间产生利息共计人民币 25,541.59 元，其中 A 类基金份额的有效认购资金在初始销售期内产生的利息为人民币 13,061.73 元；C 类基金份额的有效认购资金在初始募集期内产生的利息为人民币 12,479.86 元。以上收到的实收资金（本息）共计人民币 236,910,570.82 元，折合 236,910,570.82 份基金份额。本基金的基金管理人与注册登记机构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《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝远识混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回

购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、国债期货以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金可参与融资业务。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。本基金投资于股票（含存托凭证）资产的比例为基金资产的 60%–95%（其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%）；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债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%。如果法律法规或中国证监会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 800 指数收益率×65%+中证综合债指数收益率×20%+恒生指数（人民币）收益率×15%。

本财务报表已于 2025 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

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及 2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民

币元为单位表示。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### （1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

##### （2）金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和

实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一

项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

（2）不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

（3）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

- (5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；
- (6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；
- (7) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

- (1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可进行收益分配，具体分配方案以公告为准；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- (2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
- (3) 基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；
- (4) 本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权，但由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；
- (5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 6.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；

- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

#### 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

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

##### (1) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰ 调整为 1‰；根据财政部、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》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

##### (2) 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债券利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业

有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

### （3）城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育附加。

### （4）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

### （5）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按25%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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《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》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### （6）境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

### 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 2025年6月30日
活期存款	324,523.33
等于： 本金	324,498.74
加： 应计利息	24.59
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	324,523.33

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	15,471,733.25	-	15,875,804.19	404,070.94
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	899,865.00	11,435.18	911,435.18
	银行间市场	-	-	-
	合计	899,865.00	11,435.18	911,435.18
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	16,371,598.25	11,435.18	16,787,239.37	404,205.94

#### 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。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

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 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	609.05
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	—
其中：交易所市场	—
银行间市场	—
应付利息	—
预提费用	50,865.15
合计	51,474.20

### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

华宝远识混合 A

项目	本期	
	2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	账面金额
基金合同生效日	33,567,151.05	33,567,151.05
本期申购	85,049.31	85,049.31
本期赎回（以“-”号填列）	-25,550,171.38	-25,550,171.38
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	8,102,028.98	8,102,028.98

华宝远识混合 C

项目	本期	
	2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	账面金额
基金合同生效日	203,343,419.77	203,343,419.77
本期申购	1,447,144.92	1,447,144.92
本期赎回（以“-”号填列）	-196,736,386.44	-196,736,386.44
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	8,054,178.25	8,054,178.25

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

## 华宝远识混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	493,971.92	55,612.31	549,584.23
本期基金份额交易产生的变动数	-165,471.93	-75,546.55	-241,018.48
其中：基金申购款	1,493.70	600.69	2,094.39
基金赎回款	-166,965.63	-76,147.24	-243,112.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	328,499.99	-19,934.24	308,565.75

## 华宝远识混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	646,007.35	348,593.63	994,600.98
本期基金份额交易产生的变动数	-335,233.20	-368,646.11	-703,879.31
其中：基金申购款	28,125.96	11,010.77	39,136.73
基金赎回款	-363,359.16	-379,656.88	-743,016.04
本期已分配利润	-	-	-
本期末	310,774.15	-20,052.48	290,721.67

## 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	8,861.04
定期存款利息收入	66,728.28
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	114,631.51
其他	1,651.35
合计	191,872.18

## 6.4.7.10 股票投资收益

## 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2025年3月18日（基金合同生效日）至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	558,640.20
股票投资收益——赎回差价收入	0.00
股票投资收益——申购差价收入	0.00
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	558,640.20

#### 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年3月18日（基金合同生效日）至2025年6月30日
卖出股票成交总额	54,807,356.01
减：卖出股票成本总额	54,138,139.61
减：交易费用	110,576.20
买卖股票差价收入	558,640.20

#### 6.4.7.10.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 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 2025年3月18日（基金合同生效日）至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	1,757.59
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-245.79
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	1,511.80

##### 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 2025年3月18日（基金合同生效日）至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	203,211.14
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	199,992.00

减：应计利息总额	3,222.14
减：交易费用	242.79
买卖债券差价收入	-245.79

#### 6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

#### 6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 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。

##### 6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	475,774.56
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	475,774.56

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	404,205.94
股票投资	404,070.94
债券投资	135.00
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	404, 205. 94

#### 6. 4. 7. 17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	344, 800. 68
基金转换费收入	38. 61
合计	344, 839. 29

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 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
	2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	18, 166. 05
信息披露费	32, 699. 10
证券出借违约金	—
银行费用	3, 092. 72
其他	400. 00
证券组合费	82. 74
合计	54, 440. 61

#### 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, 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

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行交易。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

无。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

无。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

### 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 2025 年 3 月 18 日 (基金合同生效日) 至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	314,990.58

其中：应支付销售机构的客户维护费	118,673.09
应支付基金管理人的净管理费	196,317.49

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 1.2%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值  $\times$  1.2%  $/$  当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	52,498.35

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 0.2%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值  $\times$  0.2%  $/$  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		
	2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华宝远识混合 A	华宝远识混合 C	合计
华宝基金	-	2,104.29	2,104.29
华宝证券	-	46,031.24	46,031.24
招商银行	-	61,732.69	61,732.69
合计	-	109,868.22	109,868.22

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 0.6%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： $H=E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$ ， $H$  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	
	2025年3月18日（基金合同生效日）至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	324,523.33	8,861.04

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（2025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

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 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。本基金投资的金融工具主要包括股票和债券等。本基金在日常经营活动面临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及基金运作中的风险进行评估并研究制订相应的控制制度。督察长向董事会负责，总管公司的内控事务并独立地就内控制度的执行情况履行检查、评价、报告和建议职能。风险管理部在督察长指导下对公司内部控制运行情况进行监控，主要针对公司内部控制制度的总体构架和内部控制的目标进行评估并提出改进意见；合规审计部在督察长的领导下对各部门和岗位的内部控制执行情况进行监督和核查，同时对内控的失控点进行查漏并责令改正。本基金的基金管理人根据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的四层监控防线。第一层监控防线为一线岗位自控与互控；第二层防线为大业务板块内部各部门和部门之间的自控和互控；第三层监控防线为风险管理部和合规审计部对各岗位、各部门、各项业务全面实施的监督反馈；最后是以内部控制委员会为主体的第四层防线，实施对公司各类业务和风险的总体监督、控制，并对风险管理部和合规审计部的工作予以直接指导。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法是通过结合定性分析和定量分析方法，估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，

结合基金资产所运用金融工具的特征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定相应置信程度和风险损失的限度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于本报告期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金净资产的比例较低（含债券投资比例为零），因此无重大信用风险。

#### 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，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。

##### 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。本基金持

有一家公司发行的证券，其市值（同一家公司在境内和香港同时上市的，A+H 股合计计算）不超过基金资产净值的 10%，且本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在境内和香港同时上市的，A+H 股合计计算），不超过该证券的 10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制。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，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注。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；并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等。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
货币资金	324,523.33	-	-	-	324,523.33
结算备付金	246,794.09	-	-	-	246,794.09
交易性金融资产	911,435.18	-	-	15,875,804.19	16,787,239.37
应收股利	-	-	-	62,915.34	62,915.34
应收申购款	-	-	-	48,339.73	48,339.73
应收清算款	-	-	-	52,937.07	52,937.07
<b>资产总计</b>	<b>1,482,752.60</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>16,039,996.33</b>	<b>17,522,748.93</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	688,459.76	688,459.76
应付管理人报酬	-	-	-	19,301.96	19,301.96
应付托管费	-	-	-	3,216.98	3,216.98
应付销售服务费	-	-	-	4,801.38	4,801.38
其他负债	-	-	-	51,474.20	51,474.20
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>767,254.28</b>	<b>767,254.28</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>1,482,752.60</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>15,272,742.05</b>	<b>16,755,494.65</b>

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 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。本基金持有不以记账本位币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

#### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日

	美元 折合人民 币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资 产	—	3,703,675.19	—	3,703,675.19
应收股利	—	62,915.34	—	62,915.34
资产合计	—	3,766,590.53	—	3,766,590.53
以外币计价的 负债				
负债合计	—	—	—	—
资产负债表外 汇风险敞口净 额	—	3,766,590.53	—	3,766,590.53

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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 (2025 年 6 月 30 日)
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	188,329.53
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-188,329.53

#### 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，采取积极的大类资产配置策略，通过宏观策略研究，综合考虑宏观经济、国家财政政策、货币政策、产业政策、以及市场流动性等方面因素，对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪，决定大类资产配置比例；本基金将采取“自上而下”和“自下而上”的投资策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及投资组合构建的策略；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股

票(含存托凭证)资产的比例为基金资产的 60%-95%，其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债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%。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 2025 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	15,875,804.19	94.75
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	15,875,804.19	94.75

#### 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 2025 年 6 月 30 日
第一层次	15,875,804.19
第二层次	911,435.18
第三层次	-
合计	16,787,239.37

#### 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。

#### 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	15,875,804.19	90.60
	其中：股票	15,875,804.19	90.60
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	911,435.18	5.20
	其中：债券	911,435.18	5.20
	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	571,317.42	3.26
8	其他各项资产	164,192.14	0.94
9	合计	17,522,748.93	100.00

注：1、通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 3,703,675.19 元，占基金资产净值的比例为 22.10%。

2、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	-	-
B	采矿业	1,217,034.00	7.26
C	制造业	3,477,240.00	20.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	262,676.00	1.57
E	建筑业	198,517.00	1.18
F	批发和零售业	371,582.00	2.22
G	交通运输、仓储和邮政业	1,669,724.00	9.97
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	101,295.00	0.60
J	金融业	3,903,803.00	23.30
K	房地产业	61,560.00	0.37
L	租赁和商务服务业	233,513.00	1.39
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	675,185.00	4.03
S	综合	-	-
	合计	12,172,129.00	72.65

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
------	-----------	--------------

通讯	803, 254. 68	4. 79
科技	—	—
公用事业	37, 937. 12	0. 23
非必须消费品	—	—
必须消费品	—	—
能源	321, 918. 35	1. 92
金融	1, 323, 987. 25	7. 90
房地产	—	—
医疗保健	—	—
工业	730, 891. 46	4. 36
材料	485, 686. 33	2. 90
合计	3, 703, 675. 19	22. 10

注：本基金对以上行业分类采用彭博行业分类标准。

### 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	601288	农业银行	80, 400	472, 752. 00	2. 82
1	01288	农业银行	40, 000	204, 276. 80	1. 22
2	601939	建设银行	47, 700	450, 288. 00	2. 69
2	00939	建设银行	31, 000	223, 901. 96	1. 34
3	601088	中国神华	10, 600	429, 724. 00	2. 56
3	01088	中国神华	8, 000	222, 151. 02	1. 33
4	601398	工商银行	59, 100	448, 569. 00	2. 68
4	01398	工商银行	26, 000	147, 480. 55	0. 88
5	00941	中国移动	5, 500	436, 869. 65	2. 61
5	600941	中国移动	900	101, 295. 00	0. 60
6	601328	交通银行	48, 400	387, 200. 00	2. 31
6	03328	交通银行	21, 000	139, 801. 94	0. 83
7	600350	山东高速	47, 600	507, 416. 00	3. 03
8	00995	安徽皖通高速公路	24, 000	275, 773. 68	1. 65
8	600012	皖通高速	9, 900	168, 102. 00	1. 00
9	600282	南钢股份	87, 800	368, 760. 00	2. 20
10	00177	江苏宁沪高速公路	18, 000	181, 879. 31	1. 09
10	600377	宁沪高速	11, 200	171, 808. 00	1. 03
11	601169	北京银行	51, 300	350, 379. 00	2. 09
12	000429	粤高速 A	26, 200	349, 246. 00	2. 08
13	601098	中南传媒	23, 800	312, 256. 00	1. 86
14	600919	江苏银行	24, 000	286, 560. 00	1. 71
15	000937	冀中能源	45, 200	259, 900. 00	1. 55

16	601077	渝农商行	35,800	255,612.00	1.53
17	02628	中国人寿	13,000	223,354.79	1.33
18	000651	格力电器	4,900	220,108.00	1.31
19	002345	潮宏基	15,000	219,450.00	1.31
20	600757	长江传媒	23,100	214,368.00	1.28
21	00762	中国联通	24,000	203,547.24	1.21
22	600901	江苏金租	33,200	201,192.00	1.20
23	600900	长江电力	6,600	198,924.00	1.19
24	601229	上海银行	17,600	186,736.00	1.11
25	00386	中国石油化工股份	36,000	134,932.12	0.81
25	600028	中国石化	8,900	50,196.00	0.30
26	01339	中国人民保险集团	34,000	185,107.61	1.10
27	600015	华夏银行	23,100	182,721.00	1.09
28	000932	华菱钢铁	37,900	166,760.00	1.00
29	601857	中国石油	10,600	90,630.00	0.54
29	00857	中国石油股份	12,000	73,867.95	0.44
30	00914	海螺水泥	9,000	163,822.70	0.98
31	000933	神火股份	9,800	163,072.00	0.97
32	00728	中国电信	32,000	162,837.79	0.97
33	001965	招商公路	13,000	156,000.00	0.93
34	01171	兖矿能源	14,000	99,712.61	0.60
34	600188	兖矿能源	4,600	55,982.00	0.33
35	601225	陕西煤业	7,900	151,996.00	0.91
36	002867	周大生	11,400	150,252.00	0.90
37	601928	凤凰传媒	13,300	148,561.00	0.89
38	601988	中国银行	26,300	147,806.00	0.88
39	601668	中国建筑	25,100	144,827.00	0.86
40	600066	宇通客车	5,800	144,188.00	0.86
41	000895	双汇发展	5,900	144,019.00	0.86
42	600741	华域汽车	8,100	142,965.00	0.85
43	002895	川恒股份	6,300	142,128.00	0.85
44	601818	光大银行	34,200	141,930.00	0.85
45	605599	菜百股份	8,600	140,610.00	0.84
46	000157	中联重科	18,900	136,647.00	0.82
47	000333	美的集团	1,800	129,960.00	0.78
48	600153	建发股份	12,400	128,588.00	0.77
49	002807	江阴银行	25,800	122,550.00	0.73
50	002533	金杯电工	12,200	118,828.00	0.71
51	601006	大秦铁路	17,400	114,840.00	0.69
52	00883	中国海洋石油	7,000	113,118.28	0.68
53	002003	伟星股份	10,300	112,373.00	0.67
54	00998	中信银行	16,000	109,142.18	0.65

55	002563	森马服饰	19,800	104,148.00	0.62
56	600750	江中药业	4,700	102,601.00	0.61
57	00598	中国外运	27,000	97,998.15	0.58
58	06198	青岛港	16,000	96,010.10	0.57
59	000975	山金国际	4,900	92,806.00	0.55
60	02318	中国平安	2,000	90,921.42	0.54
61	601963	重庆银行	8,100	87,966.00	0.52
62	601899	紫金矿业	4,400	85,800.00	0.51
63	000963	华东医药	2,000	80,720.00	0.48
64	01186	中国铁建	16,000	79,230.22	0.47
65	601000	唐山港	19,400	78,764.00	0.47
66	600295	鄂尔多斯	8,700	75,777.00	0.45
67	000001	平安银行	6,100	73,627.00	0.44
68	600660	福耀玻璃	1,200	68,412.00	0.41
69	000581	威孚高科	3,400	64,396.00	0.38
70	002352	顺丰控股	1,300	63,388.00	0.38
71	601919	中远海控	4,000	60,160.00	0.36
72	000425	徐工机械	7,500	58,275.00	0.35
73	600755	厦门国贸	9,500	57,475.00	0.34
74	600887	伊利股份	2,000	55,760.00	0.33
75	601117	中国化学	7,000	53,690.00	0.32
76	002244	滨江集团	5,400	52,650.00	0.31
77	000338	潍柴动力	3,400	52,292.00	0.31
78	601216	君正集团	8,800	48,576.00	0.29
79	000422	湖北宜化	4,000	47,680.00	0.28
80	002027	分众传媒	6,500	47,450.00	0.28
81	002088	鲁阳节能	4,400	47,256.00	0.28
82	600000	浦发银行	3,300	45,804.00	0.27
83	002601	龙佰集团	2,800	45,388.00	0.27
84	600398	海澜之家	6,500	45,240.00	0.27
85	002541	鸿路钢构	2,600	43,524.00	0.26
86	600008	首创环保	13,600	41,072.00	0.25
87	600096	云天化	1,800	39,546.00	0.24
88	01071	华电国际电力股份	10,000	37,937.12	0.23
89	002048	宁波华翔	2,000	36,820.00	0.22
90	601658	邮储银行	6,700	36,649.00	0.22
91	002126	银轮股份	1,500	36,420.00	0.22
92	002833	弘亚数控	2,200	35,992.00	0.21
93	603699	纽威股份	1,100	34,287.00	0.20
94	002327	富安娜	3,900	28,938.00	0.17
95	002001	新和成	1,300	27,651.00	0.17
96	002050	三花智控	1,000	26,380.00	0.16
97	002966	苏州银行	2,900	25,462.00	0.15

98	300750	宁德时代	100	25,222.00	0.15
99	000830	鲁西化工	2,400	24,720.00	0.15
100	600176	中国巨石	2,100	23,940.00	0.14
101	002318	久立特材	1,000	23,390.00	0.14
102	600803	新奥股份	1,200	22,680.00	0.14
103	600285	羚锐制药	900	20,403.00	0.12
104	002478	常宝股份	2,600	13,650.00	0.08
105	600989	宝丰能源	700	11,298.00	0.07
106	600048	保利发展	1,100	8,910.00	0.05

## 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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601288	农业银行	1,925,555.00	11.49
1	01288	农业银行	658,158.10	3.93
2	601939	建设银行	1,761,502.00	10.51
2	00939	建设银行	691,466.50	4.13
3	601398	工商银行	1,698,769.00	10.14
3	01398	工商银行	457,019.95	2.73
4	601088	中国神华	1,418,457.00	8.47
4	01088	中国神华	674,661.91	4.03
5	601328	交通银行	1,454,054.00	8.68
5	03328	交通银行	608,114.29	3.63
6	600350	山东高速	2,004,405.00	11.96
7	600282	南钢股份	1,604,017.00	9.57
8	00995	安徽皖通高速公路	760,475.82	4.54
8	600012	皖通高速	724,454.00	4.32
9	000429	粤高速 A	1,434,310.00	8.56
10	000937	冀中能源	1,403,893.00	8.38
11	601098	中南传媒	1,370,374.00	8.18
12	601169	北京银行	1,364,079.00	8.14
13	00941	中国移动	1,000,389.04	5.97
13	600941	中国移动	247,688.00	1.48
14	601077	渝农商行	1,200,797.00	7.17
15	600377	宁沪高速	701,244.00	4.19
15	00177	江苏宁沪高速公路	434,798.79	2.59
16	600919	江苏银行	1,105,176.00	6.60
17	600757	长江传媒	1,036,639.00	6.19
18	601229	上海银行	929,856.00	5.55
19	600015	华夏银行	890,095.00	5.31

20	00386	中国石油化工股份	524,392.19	3.13
20	600028	中国石化	357,095.00	2.13
21	000651	格力电器	871,145.00	5.20
22	000895	双汇发展	863,626.00	5.15
23	001965	招商公路	784,865.00	4.68
24	601928	凤凰传媒	739,014.00	4.41
25	600901	江苏金租	703,380.00	4.20
26	000932	华菱钢铁	701,772.00	4.19
27	600066	宇通客车	698,564.00	4.17
28	002345	潮宏基	685,071.00	4.09
29	600900	长江电力	653,579.00	3.90
30	002867	周大生	648,761.00	3.87
31	601988	中国银行	644,199.00	3.84
31	03988	中国银行	4,023.41	0.02
32	601225	陕西煤业	628,162.00	3.75
33	600741	华域汽车	617,091.00	3.68
34	002043	兔宝宝	613,966.00	3.66
35	00762	中国联通	593,848.68	3.54
36	01171	兖矿能源	300,771.80	1.80
36	600188	兖矿能源	286,204.00	1.71
37	600153	建发股份	579,407.00	3.46
38	601857	中国石油	302,267.00	1.80
38	00857	中国石油股份	275,666.23	1.65
39	600997	开滦股份	568,522.00	3.39
40	01339	中国人民保险集团	567,095.75	3.38
41	002563	森马服饰	566,194.00	3.38
42	002807	江阴银行	562,337.00	3.36
43	00914	海螺水泥	557,170.27	3.33
44	00728	中国电信	551,309.11	3.29
45	000933	神火股份	542,558.00	3.24
46	601818	光大银行	527,760.00	3.15
46	06818	中国光大银行	6,036.01	0.04
47	02628	中国人寿	532,440.57	3.18
48	000157	中联重科	531,966.00	3.17
49	002533	金杯电工	531,161.00	3.17
50	601006	大秦铁路	519,560.00	3.10
51	002003	伟星股份	504,408.00	3.01
52	605599	菜百股份	503,002.00	3.00
53	002895	川恒股份	500,477.00	2.99
54	600295	鄂尔多斯	491,839.00	2.94
55	601668	中国建筑	489,506.00	2.92
56	600750	江中药业	461,273.00	2.75

57	000333	美的集团	445,638.00	2.66
58	601963	重庆银行	442,862.00	2.64
59	601216	君正集团	438,201.00	2.62
60	00598	中国外运	307,543.46	1.84
60	601598	中国外运	118,026.00	0.70
61	00883	中国海洋石油	412,343.76	2.46
62	600755	厦门国贸	405,544.00	2.42
63	601919	中远海控	385,530.00	2.30
63	01919	中远海控	15,879.00	0.09
64	002601	龙佰集团	371,847.00	2.22
65	000975	山金国际	346,970.00	2.07
66	600398	海澜之家	346,840.00	2.07
67	601000	唐山港	345,048.00	2.06
68	00998	中信银行	315,636.07	1.88
68	601998	中信银行	20,991.00	0.13

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601288	农业银行	1,514,824.00	9.04
1	01288	农业银行	505,431.96	3.02
2	601939	建设银行	1,319,563.00	7.88
2	00939	建设银行	503,469.18	3.00
3	601398	工商银行	1,282,790.00	7.66
3	01398	工商银行	333,797.56	1.99
4	601328	交通银行	1,106,189.00	6.60
4	03328	交通银行	491,190.76	2.93
5	600350	山东高速	1,552,383.00	9.26
6	601088	中国神华	1,027,389.00	6.13
6	01088	中国神华	456,720.84	2.73
7	000937	冀中能源	1,231,384.00	7.35
8	600282	南钢股份	1,224,225.00	7.31
9	000429	粤高速 A	1,093,562.00	6.53
10	601169	北京银行	1,068,479.00	6.38
11	600012	皖通高速	548,474.00	3.27
11	00995	安徽皖通高速公路	497,097.71	2.97
12	601077	渝农商行	1,027,061.00	6.13
13	601098	中南传媒	1,000,245.00	5.97
14	600919	江苏银行	932,039.00	5.56
15	600757	长江传媒	837,589.00	5.00
16	600377	宁沪高速	526,676.00	3.14

16	00177	江苏宁沪高速公路	269,165.79	1.61
17	601229	上海银行	774,916.00	4.62
18	00941	中国移动	585,521.01	3.49
18	600941	中国移动	148,021.00	0.88
19	00386	中国石油化工股份	402,287.66	2.40
19	600028	中国石化	308,356.00	1.84
20	600015	华夏银行	667,654.00	3.98
21	000651	格力电器	656,544.00	3.92
22	000895	双汇发展	647,051.00	3.86
23	001965	招商公路	616,871.00	3.68
24	002345	潮宏基	584,597.00	3.49
25	002043	兔宝宝	574,642.00	3.43
26	601928	凤凰传媒	571,922.00	3.41
27	600901	江苏金租	561,616.00	3.35
28	600997	开滦股份	533,513.00	3.18
29	600741	华域汽车	530,406.00	3.17
30	600066	宇通客车	522,072.00	3.12
31	000932	华菱钢铁	514,166.00	3.07
32	002867	周大生	510,457.00	3.05
33	601988	中国银行	495,166.00	2.96
33	03988	中国银行	4,256.34	0.03
34	600900	长江电力	465,359.00	2.78
35	01339	中国人民保险集团	465,001.56	2.78
36	601225	陕西煤业	462,480.00	2.76
37	002807	江阴银行	454,484.00	2.71
38	601857	中国石油	225,098.00	1.34
38	00857	中国石油股份	223,805.89	1.34
39	600188	兖矿能源	232,569.00	1.39
39	01171	兖矿能源	206,035.58	1.23
40	605599	菜百股份	437,944.00	2.61
41	600295	鄂尔多斯	434,480.00	2.59
42	600153	建发股份	432,714.00	2.58
43	002533	金杯电工	418,613.00	2.50
44	601818	光大银行	409,635.00	2.44
44	06818	中国光大银行	6,403.00	0.04
45	601006	大秦铁路	398,573.00	2.38
46	002003	伟星股份	398,164.00	2.38
47	601216	君正集团	395,331.00	2.36
48	000157	中联重科	392,997.00	2.35
49	02628	中国人寿	390,736.09	2.33
50	601963	重庆银行	389,363.00	2.32

51	000933	神火股份	388,891.00	2.32
52	00762	中国联通	387,235.88	2.31
53	002563	森马服饰	386,383.00	2.31
54	00728	中国电信	385,087.42	2.30
55	601919	中远海控	360,435.00	2.15
55	01919	中远海控	18,376.26	0.11
56	002895	川恒股份	373,073.00	2.23
57	601668	中国建筑	361,790.00	2.16
58	600755	厦门国贸	351,553.00	2.10
59	600750	江中药业	350,064.00	2.09
60	00914	海螺水泥	346,429.56	2.07
61	00598	中国外运	227,625.12	1.36
61	601598	中国外运	118,185.00	0.71

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	69,609,872.86
卖出股票收入（成交）总额	54,807,356.01

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	911,435.18	5.44
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	911,435.18	5.44

#### 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	019749	24 国债 15	9,000	911,435.18	5.44

#### 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

本基金未投资股指期货。

## 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

华宝远识混合截止 2025 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，中国农业银行股份有限公司因：1. 违反账户管理规定；2. 违反清算管理规定；3. 违反特约商户实名制管理规定；4. 违反反假货币业务管理规定；5. 违反人民币流通管理规定；6. 违反国库科目设置和使用规定；7. 占压财政存款或者资金；8. 违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定；9. 未按规定履行客户身份识别义务；10. 未按规定保存客户身份资料和交易记录；11. 未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告；12. 与身份不明的客户进行交易；于 2024 年 12 月 30 日收到中国人民银行警告，没收违法所得 487.594705 万元，罚款 4672.941544 万元的处罚措施。

华宝远识混合截止 2025 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违反金融统计管理规定；于 2025 年 03 月 28 日收到中国人民银行罚款的处罚措施。

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。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	—
2	应收清算款	52,937.07
3	应收股利	62,915.34
4	应收利息	—
5	应收申购款	48,339.73
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	164,192.14

### 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(%)
华宝远识混合 A	392	20,668.44	0.00	0.00	8,102,028.98	100.00
华宝远识混合 C	952	8,460.27	0.00	0.00	8,054,178.25	100.00
合计	1,344	12,020.99	0.00	0.00	16,156,207.23	100.00

### 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	华宝远识混合 A	0.00	0.0000
	华宝远识混合 C	0.00	0.0000
	合计	0.00	0.0000

### 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	华宝远识混合 A	0
	华宝远识混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华宝远识混合 A	0
	华宝远识混合 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华宝远识混合 A	华宝远识混合 C
基金合同生效日 (2025 年 3 月 18 日) 基金份额总额	33,567,151.05	203,343,419.77
基金合同生效日起 至报告期期末基金 总申购份额	85,049.31	1,447,144.92
减：基金合同生效 日起至报告期期末 基金总赎回份额	25,550,171.38	196,736,386.44
基金合同生效日起 至报告期期末基金 拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金 份额总额	8,102,028.98	8,054,178.25

注：本基金合同生效日于 2025 年 03 月 18 日。

## § 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

2025 年 1 月 9 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，聘任吕笑然为公司副总经理。

2025 年 6 月 27 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，吕笑然不再担任公司副总经理。

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、基金财产的诉讼事项。本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼。

### 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

目前该会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：本基金合同生效之日起至本报告期末。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用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 (%)	
长江证券	3	124,417,228 .87	100.00	75,551.52	100.00	-

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管理费用管理规定》和公司《公募基金及私募资产管理计划专用交易席位管理办法》的要求, 公司与符合前述标准的证券公司, 签订《证券交易单元租用协议》, 参与证券交易。

2、本报告期租用的证券公司交易单元均为新增。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
长江证券	1,213,967.87	100.00	1,063,880.00	0.00	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华宝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	2025-01-14
2	华宝基金关于华宝远识混合型证券投资基金新增代销机构的公告	基金管理人网站, 证券时报	2025-02-05
3	华宝基金关于华宝远识混合型证券投资基金新增代销机构的公告	基金管理人网站, 证券时报	2025-02-17
4	华宝基金关于华宝远识混合型证券投资基金新增华福证券有限责任公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 证券时报	2025-02-19
5	华宝基金关于旗下部分基金新增东方财富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	2025-02-19

6	华宝基金关于华宝远识混合型证券投资基金新增恒泰证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 证券时报	2025-03-13
7	华宝远识混合型证券投资基金基金合同生效公告	基金管理人网站, 证券时报	2025-03-19
8	华宝远识混合型证券投资基金开放日常申购、赎回及转换和定期定额投资业务的公告	基金管理人网站, 证券时报	2025-03-22
9	华宝基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法调整的公告	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	2025-04-22
10	华宝基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2025-04-22
11	华宝远识混合型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2025-04-22
12	华宝基金关于旗下部分基金新增中国建设银行股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2025-05-21
13	华宝基金关于旗下部分基金新增英大证券有限责任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	2025-05-28
14	关于华宝远识混合型证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告	基金管理人网站, 证券时报	2025-06-26

## § 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	20250318~20250512	0.00	50,000,000.00	50,000,000.00	0.00	0.00

#### 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

### § 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；  
华宝远识混合型证券投资基金基金合同；  
华宝远识混合型证券投资基金招募说明书；  
华宝远识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

2025 年 8 月 29 日