

鹏华瑞衡鑫益 180 天持有期债券型证券投资
基金
2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业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 04 月 21 日（基金合同生效日）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	9
2.4 信息披露方式	9
2.5 其他相关资料	9
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	9
3.1 主要会计数据和财务指标	9
3.2 基金净值表现	10
3.3 其他指标	12
§ 4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	17
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
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	17
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	19
6.3 净资产变动表	20
6.4 报表附注	21
§ 7 投资组合报告	48
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
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	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
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	60
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	61

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	61
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	61
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
7.11 本报告期投资基金情况	61
7.12 投资组合报告附注	62
§ 8 基金份额持有人信息	63
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
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	63
§ 9 开放式基金份额变动	63
§ 10 重大事件揭示	64
10.1 基金份额持有人大会决议	64
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	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
10.4 基金投资策略的改变	64
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	64
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	64
10.8 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	65
10.9 其他重大事件	69
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	70
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	70
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	70
§ 12 备查文件目录	70
12.1 备查文件目录	70
12.2 存放地点	71
12.3 查阅方式	71

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华瑞衡鑫益 180 天持有期债券型证券投资基金	
基金简称	鹏华瑞衡鑫益 180 天持有期债券	
基金主代码	027037	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2026 年 4 月 21 日	
基金管理人	鹏华基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	632,110,089.20 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	鹏华瑞衡鑫益 180 天持有期债券 A	鹏华瑞衡鑫益 180 天持有期债券 C
下属分级基金的交 易代码	027037	027038
报告期末下属分级 基金的份额总额	508,666,528.47 份	123,443,560.73 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，合理配置债券等固定收益类资产和权益类资产，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1、资产配置策略 本基金通过对宏观环境、政策导向、大类资产风险收益状态、投资者行为、市场情绪、市场风险偏好等进行系统分析和评估，合理确定基金在股票、债券、基金等各类资产类别上的投资比例，并根据各类资产风险收益特征的相对变化和基金资产状况，适时动态调整各类资产的投资比例，并依靠严格的投资纪律和风险控制，以保证在控制风险的前提下实现收益最大化。 2、债券投资策略 本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用资产投资策略（含资产支持证券）、可转债投资策略及可交换债券投资策略等积极投资策略，自上而下地管理组合的久期，灵活地调整组合的券种搭配，同时精选个券，以增强组合的持有期收益。 （1）久期策略 久期管理是债券投资的重要考量因素，本基金将采用以“目标久期”为中心、自上而下的组合久期管理策略。 （2）收益率曲线策略 收益率曲线的形状变化是判断市场整体走向的一个重要依据，本基金将据此调整组合长、中、短期债券的搭配，并进行动态调整。

	(3) 骑乘策略 本基金将采用基于收益率曲线分析对债券组合进行适时调整的骑乘策略，以达到增强组合的持有期收益的目的。 (4) 息差策略 本基金将采用息差策略，以达到更好地利用杠杆放大债券投资的收益的目的。 (5) 个券选择策略 本基金将根据单个债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度，结合信用等级、流动性、选择权条款、税赋特点等因素，确定其投资价值，选择定价合理或价值被低估的债券进行投资。 (6) 信用资产投资策略（含资产支持证券） 本基金通过主动承担适度的信用风险来获取信用溢价，根据内、外部信用评级结果，结合对类似资产信用利差的分析以及对未来信用利差走势的判断，选择信用利差被高估、未来信用利差可能下降的信用资产进行投资。其中，本基金投资信用资产的评级范围为 AA+至 AAA，投资于各个信用等级信用资产占信用资产的大致比例如下： <table> <tr> <td>信用等级</td><td>占比</td></tr> <tr> <td>AAA</td><td>50%-100%</td></tr> <tr> <td>AA+</td><td>0%-50%</td></tr> </table> 其中，短期融资券、超短期融资券等短期信用资产的信用评级参考主体评级，其它信用资产采用债项评级，如无债项评级则参考主体评级。 本基金持有信用资产期间，如果其评级下降、不再符合上述约定，应在评级报告发布之日起 3 个月内调整至符合约定。 (7) 可转债投资策略及可交换债券投资策略 1) 传统可转债投资策略 传统可转债即可转换公司债券，兼具债权和股权双重属性。债权属性是指投资者可以选择持有可转债到期，得到本金与利息收益；股权属性即股票期权属性，是指投资者可以在转股期间以约定的转股价格把可转债转换成股票。因此，可转债的价格由债权价格和期权价格两部分组成。 a. 个券选择策略。一方面，本基金将对所有可转债对应的标的股票进行深入研究，采用定性分析（行业地位、竞争优势、治理结构、市场开拓、创新能力等）与定量分析（P/B、P/E、PEG、DCF、DDM、NAV 等）相结合的方式挑选成长性好且估值合理的正股；另一方面，本基金将深入研究分析可转债自身的信用评估。综上所述，本基金将结合可转债自身的信用评估和其正股的价值分析，作为选取个券的重要依据。 b. 条款价值发现策略。可转债一般均设有一些特殊条款，包括修正转股价条款、回售条款、赎回条款等，这些条款在特定环境下对可转债价值有着较大的影响。本基金将通过有效分析相关信息力争把握各项条款给可转债带来的可能的投资机会。 c. 套利策略。可转债可以按照约定的价格转换为股票，因此在日常交易运作过程中会出现可转债与标的股票之间的套利机会。当	信用等级	占比	AAA	50%-100%	AA+	0%-50%
信用等级	占比						
AAA	50%-100%						
AA+	0%-50%						

	处于转股期内的可转债市价低于转股价值，即可转债的转换溢价率为负时，买入可转债的同时卖出标的股票可以获得套利价差；反之，买入标的股票的同时卖出可转债也可以获取反向套利价差。在日常交易运作中，本基金将密切关注可转债与标的股票之间价格之间的对比关系，择机实施套利策略，以增强本基金的收益。 2) 分离交易可转债投资策略 本基金在对这类债券基本情况进行研究的同时，将重点分析附权部分对债券估值的影响。对于分离交易可转债的债券部分将按照债券投资策略进行管理，权证部分将在可交易之日起不超过 3 个月的时间内卖出。 3) 可交换债券投资策略 可交换债券具有股性和债性，其中债性，即选择持有可交换债券至到期以获取票面价值和票面利息；而对于股性的分析则需关注目标公司的股票价值。本基金将通过对目标公司股票的投资价值分析和可交换债券的纯债部分价值分析综合开展投资决策。 3、股票投资策略 本基金在股票投资方面主要采用量化模型选股策略构建投资组合，同时运用数量化方法优化组合交易并控制组合风险，实现超额收益。 (1) 量化选股模型 本基金将以多因子量化选股模型构建股票组合。多因子模型针对个股构建价值、质量、动量、反转、成长、一致预期、市场交易行为数据等因子，通过量化方法处理因子与个股超额回报之间的特征关系，挑选出具有基本面逻辑支撑和统计意义有效的因子组合，进而得出具有稳定超额回报的股票组合。本基金对因子的有效性进行持续的跟踪，分析其变化规律，基金经理根据市场状况结合因子变化趋势，对模型使用的因子结构进行动态调整。 (2) 组合优化策略 本基金将充分保证持股数量在一定的水平，通过分散化权重，降低组合集中度风险；对投资组合的因子暴露程度进行分析，合理控制组合整体风险水平。本基金将综合考虑市场变化、预期回报、预期风险、流动性以及交易成本等因素，对选股结果进行优化，以确定个股的权重，构建风险收益最优的组合。 (3) 策略与模型的动态调整 基金管理人将根据市场变化趋势以及后续深入持续的研究，选择适合当前市场环境的投资策略，定期或不定期地对数量化模型进行复核与检验，并对模型涉及的因子与策略进行修正与调整，不断改善模型的有效性与稳定性，以使得本基金能够有效达成投资目标。 (4) 港股通标的股票投资策略 本基金所投资港股通标的股票除适用上述个股投资策略外，还需关注： 1) 在港股市场上市、具有行业代表性的优质中资公司； 2) 具有行业稀缺性的香港本地和外资公司；
--	--

	3) 港股市场在行业结构、估值、AH 股折溢价、分红率等方面具有吸引力的投资标的。 4、存托凭证投资策略 本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。 5、基金投资策略 针对基金投资，本基金投资于全市场的股票型 ETF 及基金管理人旗下的权益类基金（包括股票型基金、计入权益类资产的混合型基金）。其中，计入权益类资产的混合型基金需至少符合下列两个条件之一： （1）基金合同约定的股票及存托凭证资产投资比例不低于基金资产的 60%； （2）最近四个季度定期报告中披露的股票及存托凭证资产占基金资产比例均不低于 60%。 本基金基于权益类基金投资目标的不同，将标的基金分为主动管理型基金和被动管理型基金两大类。其中，针对主动管理型基金，基金管理人采用定量分析和定性分析相结合的方式。一方面基于对市场中长期投资趋势的判断，运用基金分析评价体系通过严格的量化规则筛选有潜在投资价值的标的纳入研究范围，主要参考基金规模、流动性、历史业绩、风险调整后的收益、持仓特征、风格暴露、行业板块配置等一系列量化指标对基金进行归因分析，精选出预期能够获得良好业绩的基金。另一方面结合所选基金的基金管理人的基本情况和投研文化等定性因素进行二次研判，双重维度力求筛选出中长期业绩稳定的优秀基金。 针对被动管理型基金，本基金从标的指数表现、跟踪误差、超额收益、流动性、规模变化等多角度进行分析，选取出表现稳定，符合未来市场发展方向的基金。对于增强型指数基金增加对增强效果的评估。 本基金还将定期对投资组合进行回顾和动态调整，剔除不再符合筛选标准的基金，增加符合筛选标准的基金，以实现基金投资组合的优化。 6、国债期货投资策略 本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。 未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可在履行适当程序后相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书中更新并公告。
业绩比较基准	中债-综合全价（总值）指数收益率×87%+中证全指指数收益率×10%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×3%

风险收益特征	本基金属于债券型基金，其预期收益及预期风险高于货币市场基金，但低于股票型基金、混合型基金。 本基金若投资港股通标的股票，会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。
--------	--

注：无。

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		鹏华基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	高永杰	任航
	联系电话	0755-81395402	010-66060069
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4006788533	95599
传真		0755-82021126	010-68121816
注册地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518048	100031
法定代表人		张纳沙	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.phfund.com.cn
基金中期报告置备地点	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	鹏华基金管理有限公司	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数	2026 年 4 月 21 日（基金合同生效日）-2026 年 6 月 30 日	
据和指标	鹏华瑞衡鑫益 180 天持有期债券 A	鹏华瑞衡鑫益 180 天持有期债券 C
本期已实现收益	1,281,739.83	263,637.29
本期利润	1,500,852.21	316,750.91
加权平均基金份额本期利润	0.0030	0.0026

本期加权平均净 值利润率	0.29%	0.26%
本期基金份额净 值增长率	0.30%	0.26%
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	1,281,739.83	263,637.29
期末可供分配基 金份额利润	0.0025	0.0021
期末基金资产净 值	510,167,380.68	123,760,311.64
期末基金份额净 值	1.0030	1.0026
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	0.30%	0.26%

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，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益等未实现收益。

(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（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(3) 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分的期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一日，即 6 月 30 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

(4) 本基金基金合同于 2026 年 04 月 21 日生效，至 2026 年 06 月 30 日 未满 6 个月。

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

鹏华瑞衡鑫益 180 天持有期债券 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
自基金合同生效 起至今	0.30%	0.07%	0.19%	0.16%	0.11%	-0.09%

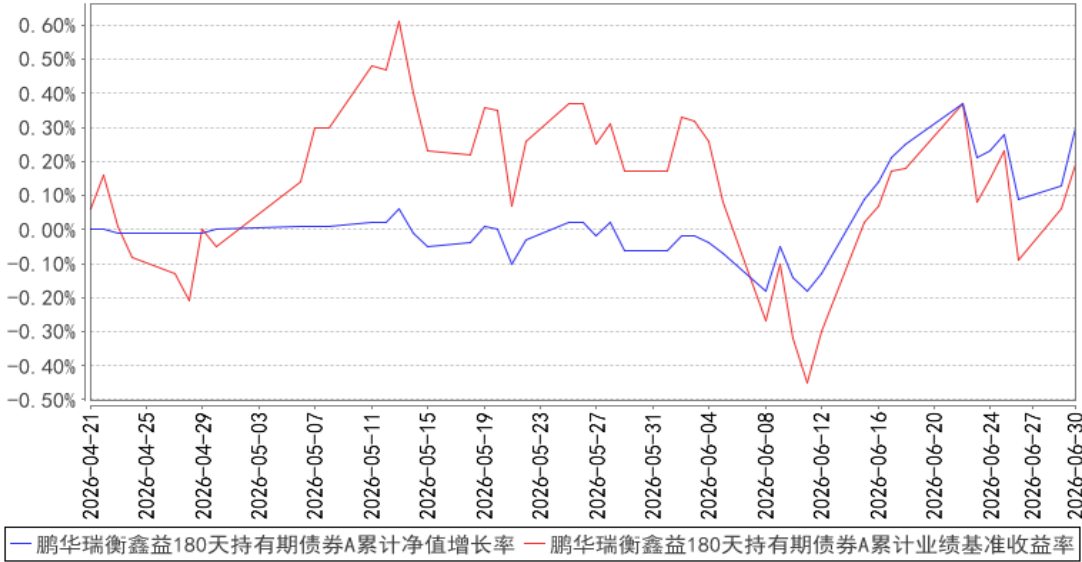
鹏华瑞衡鑫益 180 天持有期债券 C

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
自基金合同生效 起至今	0.26%	0.07%	0.19%	0.16%	0.07%	-0.09%

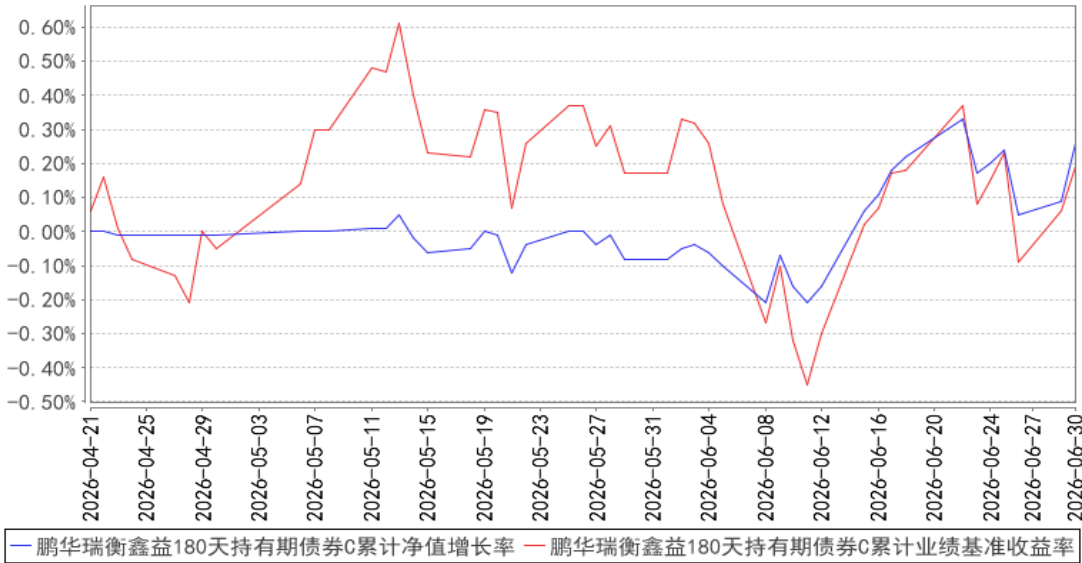
注：业绩比较基准=中债-综合全价（总值）指数收益率×87%+中证全指指数收益率×10%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×3%。

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

鹏华瑞衡鑫益180天持有期债券A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



鹏华瑞衡鑫益180天持有期债券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、本基金基金合同于 2026 年 04 月 21 日生效，截至本报告期末本基金基金合同生效未
满一年。2、本基金管理人将严格按照本基金合同的约定，于本基金建仓期届满后确保各项投资比例
符合基金合同的约定。

3.3 其他指标

注：无。

§ 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

鹏华基金管理有限公司成立于 1998 年 12 月 22 日，业务范围包括基金募集、基金销售、资产
管理及中国证监会许可的其他业务。截至本报告期末，公司股东由国信证券股份有限公司、意大
利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）、深圳市北融信投资发展有
限公司组成，公司性质为中外合资企业，公司注册资本 15,000 万元人民币。截至本报告期末，公
司管理资产总规模为 15,047 亿元，公司管理着 410 只公募基金，23 只社保基金、养老基金及划
转资本组合。历经二十余年基金投资管理实践，公司在基金投资运作、风险控制等方面积累了丰
富经验。

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		
寇斌 权	本基金的 基金经理	2026-04- 21	-	8 年	寇斌权先生, 国籍中国, 物理学博士, 8 年 证券从业经验。2018 年 7 月加盟鹏华基 金管理有限公司, 历任量化及衍生品投资 部大数据分析研究助理、量化研究员、高 级量化研究员、资深量化研究员, 现担任 指数与量化投资部基金经理。2023 年 06 月至 2026 年 06 月担任鹏华弘华灵活配 置混合型证券投资基金基金经理, 2023 年 09 月至 2025 年 06 月担任鹏华弘实灵 活配置混合型证券投资基金基金经理, 2023 年 09 月至今担任鹏华弘达灵活配置 混合型证券投资基金基金经理, 2023 年 12 月至 2026 年 04 月担任鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基 金基金经理, 2023 年 12 月至今担任鹏华 畅享债券型证券投资基金基金经理, 2024 年 08 月至 2026 年 04 月担任鹏华上

					证科创板 50 成份增强策略交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，2025 年 04 月至今担任鹏华中证 800 自由现金流交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 04 月至今担任鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，2025 年 04 月至今担任鹏华安荣混合型证券投资基金基金经理，2025 年 06 月至今担任鹏华中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 07 月至今担任鹏华中证 800 自由现金流交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2025 年 08 月至今担任鹏华安益增强混合型证券投资基金基金经理，2025 年 11 月至今担任鹏华睿丰债券型证券投资基金基金经理，2026 年 04 月至今担任鹏华瑞衡鑫益 180 天持有期债券型证券投资基金基金经理，2026 年 06 月至今担任鹏华瑞衡鑫诚债券型证券投资基金基金经理，寇斌权先生具备基金从业资格。
杜培俊	本基金的基金经理	2026-04-21	-	12 年	杜培俊先生，国籍中国，经济学硕士，12 年证券从业经验。曾任民生银行石材产业金融事业部、市场业务部客户经理，兴业基金管理有限公司投资管理部研究员。2018 年 03 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任固定收益部信用研究员，固定收益研究部高级信用研究员、基金经理助理，现担任债券投资一部基金经理。2021 年 03 月至 2024 年 04 月担任鹏华丰惠债券型证券投资基金基金经理，2021 年 03 月至 2024 年 06 月担任鹏华永盛一年定期开放债券型证券投资基金基金经理，2021 年 03 月至 2025 年 09 月担任鹏华丰诚债券型证券投资基金基金经理，2021 年 03 月至今担任鹏华丰达债券型证券投资基金基金经理，2021 年 03 月至今担任鹏华丰茂债券型证券投资基金基金经理，2021 年 03 月至今担任鹏华尊信 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，2021 年 04 月至 2022 年 04 月担任鹏华丰腾债券型证券投资基金基金经理，2021 年 05 月至今担任鹏华尊达一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。

					理，2023 年 06 月至 2026 年 03 月担任鹏华永宁 3 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，2023 年 06 月至今担任鹏华丰顺债券型证券投资基金基金经理，2023 年 07 月至今担任鹏华丰康债券型证券投资基金基金经理，2024 年 08 月至 2026 年 03 月担任鹏华丰惠债券型证券投资基金基金经理，2024 年 12 月至今担任鹏华绿色债券债券型证券投资基金基金经理，2026 年 02 月至今担任鹏华金利债券型证券投资基金基金经理，2026 年 02 月至今担任鹏华双季乐 180 天持有期债券型证券投资基金基金经理，2026 年 04 月至今担任鹏华瑞衡鑫益 180 天持有期债券型证券投资基金基金经理，杜培俊先生具备基金从业资格。
--	--	--	--	--	--

注：1. 任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，任职日期为基金合同生效日。2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格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

注：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

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及基金合同的约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合规，不存在违反基金合同和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

报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度，确保不同投资组合在研究、交易、分配等各环节得到公平对待。公司对不同投资组合在不同时间窗口下（日内、3 日内、5 日内）的同向交易价差进行专项分析，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价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，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易。

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

报告期内，经济基本面一季度表现较好，二季度有所下行，上半年整体表现相对平稳。通胀方面，2-3 月受到地缘冲突爆发导致原油和相关化工品价格上涨，以及 AI 周期带动产业链相关品种涨价，通胀预期一度有所上升，但由于并非由需求端引起的广义价格上行，对债市的扰动相对有限。货币政策方面，央行继续实施适度宽松的货币政策，资金面整体平稳偏松。债券市场收益率震荡下行，信用利差低位波动，但期限利差整体压缩有限。本基金成立于 4 月，在建仓初期对债券逐步进行建仓，整体组合久期水平保持在中性偏低水平。

报告期内，本基金权益端采用量化模型进行选股，继续坚持动态配置不同预测收益来源、不同预测周期的因子；并继续加大对低相关性、有效投资因子的研发力度。与此同时，持续跟踪市场波动加剧时期的资金面和情绪面对风格切换的影响。以稳健均衡、动态适应市场环境的风格、在模型长期有效性和对短期市场环境波动的适应性中寻找平衡。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期 A 类份额净值增长率为 0.30%，同期业绩比较基准增长率为 0.19%；C 类份额净值增长率为 0.26%，同期业绩比较基准增长率为 0.19%。

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，科技及出口景气度预计仍维持较强，内需方面，随着财政发债的加速，预计能小幅回暖，但整体回暖力度预计偏小。货币政策方面，在基本面平稳运行的基础上，货币政策预计仍将延续适度宽松，以在传统动能仍然相对偏弱的背景下支持实体经济运行。

在基本面相对平稳，货币政策维持适度宽松的情况下，预计债市整体将维持震荡，考虑到三季度为政府债发行高峰期，且利率债期限利差整体维持相对高位，关注在政府债发行高峰接近结束后潜在的期限利差压缩机会，但仍需要高度关注基本面、通胀预期是否配合。

上半年权益市场整体出现较大分化，中东战争的忽然爆发，以及随后的阶段性缓和与反复，对非科技、非成长的例如周期板块带来较大扰动。AI 的共识逐步加深，持续性利好科技成长板块，上半年市场充分重估、定价了科技产业趋势和硬科技资产。展望 2026 年下半年，科技板块仍有产业催化和政策支撑，但估值继续扩张的约束也在增强。科技板块结构性机会仍然存在：其中半导体机会既来自周期修复，也来自国产替代向更深层次推进；AI 方向算力硬件仍是业绩兑现相对清晰的环节。但科技板块波动可能同步放大：部分细分方向交易拥挤度已经抬升，海外 AI 资本开支预期、美元流动性和全球科技股波动都可能放大板块波动或形成分化。科技公司研发强度高、盈利弹性大，行情能否延续关键要看产业趋势能否进一步落到订单、收入、利润和现金流。海外顶尖

闭源模型与国产开源模型的竞争仍然是未来科技方向关键影响因素。国产开源模型如果没有被海外闭源模型显著拉开代差的情况下、实际模型能力超过某一临界点之后，用户是否从性能最优转向性价比最优会对未来市场对 AI 估值产生较为深远的影响：大模型应用对算力、存储的长期需求是确定的，而未来算力、存储是否会从周期性成长属性转为公用事业属性值得持续性研究与跟踪。由于本轮 AI 革命形成了全球性共识和全球科技产业协作，科技板块形成了全球跨地区、跨市场的共振，那么海外市场的一些高风险敞口的交易一旦出现流动性风险也可能对于 A 股市场有传导和冲击。我们认为未来科技与非科技方向的轮动或者再平衡，有一定概率会重复极致再平衡。综上，下半年我们相对看好科技方向特别是与 AI 相关性比较高的产业链或双创成长板块，与现金流或红利风格的哑铃策略或轮动策略。

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相关指引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。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术。

本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人设有估值委员会，由登记结算部、风控管理部、监察稽核部、各投资部门、研究部门负责人、基金经理等成员组成，估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规和基金估值运作等方面的专业能力。基金经理可与估值委员会成员共同商定估值原则和政策，但不参与日常估值的执行。

基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值发生重大变化的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与第三方定价服务机构签署服务协议，由其按约定提供相关参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末，鹏华瑞衡鑫益 180 天持有期债券 A 期末可供分配利润为 1,281,739.83 元，期末基金份额净值 1.0030 元；鹏华瑞衡鑫益 180 天持有期债券 C 期末可供分配利润为 263,637.29 元，期末基金份额净值 1.0026 元。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

3、根据相关法律法规及本基金基金合同的规定，本基金管理人将会综合考虑各方面因素，在严格遵守规定前提下，对本报告期内可供分配利润适时作出相应安排。

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

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国农业银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）在本基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对本基金的投资运作情况进行了必要的监督，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支、利润分配等方面进行了复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

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

本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，以自身能够获取的数据和信息为限，对本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行核查，以上内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：鹏华瑞衡鑫益 180 天持有期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
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	25,250,677.44
结算备付金		569,769.11
存出保证金		42,381.69
交易性金融资产	6.4.7.2	640,452,512.33
其中：股票投资		53,774,355.08

基金投资		-
债券投资		586,678,157.25
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	6.4.7.5	-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资	6.4.7.6	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.8	-
资产总计		666,315,340.57
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 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		12,700,000.00
应付清算款		19,311,870.01
应付赎回款		-
应付管理人报酬		207,916.97
应付托管费		51,979.25
应付销售服务费		20,296.97
应付投资顾问费		-
应交税费		14,604.58
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.9	80,980.47
负债合计		32,387,648.25
净资产：		
实收基金	6.4.7.10	632,110,089.20
其他综合收益	6.4.7.11	-
未分配利润	6.4.7.12	1,817,603.12
净资产合计		633,927,692.32
负债和净资产总计		666,315,340.57

注：（1）报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额为 632,110,089.20 份，其中鹏华瑞衡鑫益 180 天持有期债券 A 基金份额总额为 508,666,528.47 份，基金份额净值 1.0030 元；鹏华瑞衡鑫益 180 天持有期债券 C 基金份额总额为 123,443,560.73 份，基金份额净值 1.0026 元。（2）本财务报表的实际编制期间为 2026 年 04 月 21 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日，无上年度末数据。

6.2 利润表

会计主体：鹏华瑞衡鑫益 180 天持有期债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 4 月 21 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 4 月 21 日（基金合 同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		2,498,620.37
1. 利息收入		422,665.89
其中：存款利息收入	6.4.7.13	30,289.53
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		392,376.36
其他利息收入		—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,803,728.48
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-76,449.89
基金投资收益	6.4.7.15	—
债券投资收益	6.4.7.16	1,662,618.89
资产支持证券投资收益	6.4.7.17	—
贵金属投资收益	6.4.7.18	—
衍生工具收益	6.4.7.19	—
股利收益	6.4.7.20	217,559.48
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）	6.4.7.21	272,226.00
4. 汇兑收益（损失以“-”号填 列）		—
5. 其他收入（损失以“-”号填 列）	6.4.7.22	—
减：二、营业总支出		681,017.25
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	484,982.92
其中：暂估管理人报酬		—

2. 托管费	6.4.10.2.2	121,245.73
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	47,348.47
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		9,921.96
其中：卖出回购金融资产支出		9,921.96
6. 信用减值损失	6.4.7.24	-
7. 税金及附加		3,614.08
8. 其他费用	6.4.7.25	13,904.09
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,817,603.12
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,817,603.12
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		1,817,603.12

注：本财务报表的实际编制期间为 2026 年 04 月 21 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日止期间，无上年度可比期间及可比较数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：鹏华瑞衡鑫益 180 天持有期债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 4 月 21 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 4 月 21 日（基金合同生效日）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	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	632,110,089.20	-	-	632,110,089.20
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	1,817,603.12	1,817,603.12
（一）、综合收益总额	-	-	1,817,603.12	1,817,603.12
（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）				
其中：1. 基金申购款	－	－	－	－
2. 基金赎回款	－	－	－	－
（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	632,110,089.20	－	1,817,603.12	633,927,692.32

注：本财务报表的实际编制期间为 2026 年 04 月 21 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日止期间，无上年度可比较期间及可比较数据。

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：

邓召明
基金管理人负责人

聂连杰
主管会计工作负责人

郝文高
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

鹏华瑞衡鑫益 180 天持有期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[2026]451 号文《关于准予鹏华瑞衡鑫益 180 天持有期债券型证券投资基金注册的批复》准予，由鹏华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《鹏华瑞衡鑫益 180 天持有期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基金，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 631,932,185.36 元，业经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)毕马威华振验字第 2600127 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏华瑞衡鑫益 180 天持有期债券型证券投资基金基金合同》于 2026 年 4 月 21 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 632,110,089.20 份基金份额，其中认购资金利息折合 177,903.84 份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金

管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14号)、中国证监会颁布的《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第2号—定期报告的内容与格式》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《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》和《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华瑞衡鑫益 180 天持有期债券型证券投资基金基金合同》以及在财务报表附注中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 2026 年 04 月 21 日(基金合同生效日)至 2026 年 06 月 30 日止期间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 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年 04 月 21 日(基金合同生效日)至 2026 年 06 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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2026 年 04 月 21 日(基金合同生效日)至 2026 年 06 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具,是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时,确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具,分别采用以下两种方式进行计量:

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具；即不包含付款的合同义务且享有发行人净资产和剩余收益的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具（主要为股票投资）按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

（2）金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工

具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金在上一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：（1）收取该金融资产现金流量的合同权利终止；（2）该金融资产已转移，且本基金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；或者（3）该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、基金投资、资产支持证券投资和衍生工具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其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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) 当金融工具不存在活跃市场，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。采用估值技术时，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，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。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认列。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平准金和未实现平准金。已实现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损益占净资产比例计算的金额。未实现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损益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认列，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

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税（和/或）股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分

属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率或者发行价计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费(如有)在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的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

本基金同一类/级别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

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入账。

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

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。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)本基金的基金管理人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)本基金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。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，若出现以下情形，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易场所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易场所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易场所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易场所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》和财政部、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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会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[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[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会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》、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》、财税[2025] 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、财税[2026]10 号《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。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，截至 2027 年 12 月 31 日适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入，截至 2027 年 12 月 31 日免征增值税；对金融同业往来利息收入，截至 2027 年 12 月 31 日免征增值税；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（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续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 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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	25,250,677.44
等于：本金	25,250,144.94
加：应计利息	532.50
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	25,250,677.44

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		52,862,862.50	-	53,774,355.08	911,492.58
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	272,453,871.69	1,578,883.28	273,488,883.28	-543,871.69
	银行间市场	308,596,394.89	4,688,273.97	313,189,273.97	-95,394.89
	合计	581,050,266.58	6,267,157.25	586,678,157.25	-639,266.58
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		633,913,129.08	6,267,157.25	640,452,512.33	272,226.00

注：股票投资的成本、公允价值及公允价值变动均包含中国存托凭证的成本、公允价值及公允价值变动。

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

注：无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：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

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

注：无。

6.4.7.9 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	69,843.41
其中：交易所市场	52,838.39
银行间市场	17,005.02
应付利息	-
预提费用	11,137.06
合计	80,980.47

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

鹏华瑞衡鑫益 180 天持有期债券 A

项目	本期 2026 年 4 月 21 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
----	---

	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	508,666,528.47	508,666,528.47
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	508,666,528.47	508,666,528.47

鹏华瑞衡鑫益 180 天持有期债券 C

项目	本期 2026 年 4 月 21 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	123,443,560.73	123,443,560.73
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	123,443,560.73	123,443,560.73

注：1、本基金自 2026 年 4 月 1 日至 2026 年 4 月 17 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 631,932,185.36 元，折合为 631,932,185.36 份基金份额（其中 A 类基金份额 508,520,959.97 份，C 类基金份额 123,411,225.39 份）。根据《鹏华瑞衡鑫益 180 天持有期债券型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 177,903.84 元，在本基金成立后，折合为 177,903.84 份基金份额（其中 A 类基金份额 145,568.50 份，C 类基金份额 32,335.34 份），划入基金份额持有人账户。

2、申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

鹏华瑞衡鑫益 180 天持有期债券 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	1,281,739.83	219,112.38	1,500,852.21
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	1,281,739.83	219,112.38	1,500,852.21

鹏华瑞衡鑫益 180 天持有期债券 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	263,637.29	53,113.62	316,750.91
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	263,637.29	53,113.62	316,750.91

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 4 月 21 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	26,788.95
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	2,088.40
其他	1,412.18
合计	30,289.53

注：其他包含认/申购款利息收入、结算保证金利息收入、风控金利息收入等。

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年4月21日（基金合同生效日）至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-76,449.89
股票投资收益——赎回差价收入	-

股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-76,449.89

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 4 月 21 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	32,159,774.14
减：卖出股票成本总额	32,159,793.36
减：交易费用	76,430.67
买卖股票差价收入	-76,449.89

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.15 基金投资收益

注：无。

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年4月21日（基金合同生效日）至2026年6 月30日
债券投资收益——利息收入	2,254,358.28
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-591,739.39
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	1,662,618.89

6.4.7.16.2 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4月21日（基金合同生效日）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	163,089,590.57

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	160,673,496.39
减：应计利息总额	3,004,383.57
减：交易费用	3,450.00
买卖债券差价收入	-591,739.39

6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.18 贵金属投资收益

6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.19 衍生工具收益

6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 4 月 21 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	217,559.48
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	217,559.48

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 4 月 21 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	272,226.00
股票投资	911,492.58
债券投资	-639,266.58
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	272,226.00

6.4.7.22 其他收入

注：无。

6.4.7.23 持有基金产生的费用

注：无。

6.4.7.24 信用减值损失

注：无。

6.4.7.25 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 4 月 21 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	11,137.06
信息披露费	-

证券出借违约金	-
银行汇划费用	2,767.03
合计	13,904.09

6.4.7.26 分部报告

无。

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

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

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
鹏华基金管理有限公司（“鹏华基金公司”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金代销机构

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

本基金基金合同于 2026 年 04 月 21 日生效，截至本报告期末不满一年，无上年度可比期间数据。

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

注：无。

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.4 基金交易

注：无。

6.4.10.1.5 权证交易

注：无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

注：无。

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 4 月 21 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	484,982.92
其中：应支付销售机构的客户维护费	240,278.23
应支付基金管理人的净管理费	244,704.69

注：1、支付基金管理人鹏华基金公司的管理人报酬年费率为 0.40%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.40%÷当年天数。

2、根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，基金管理人依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，客户维护费从基金管理费中列支。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 4 月 21 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	121,245.73

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/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 4 月 21 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华瑞衡鑫益 180 天 持有期债券 A	鹏华瑞衡鑫益 180 天 持有期债券 C	合计
鹏华基金公司	-	3.56	3.56

中国农业银行	-	46,591.80	46,591.80
合计	-	46,595.36	46,595.36

注：鹏华瑞衡鑫益 180 天持有期债券 A 基金份额不支付销售服务费；支付基金销售机构的鹏华瑞衡鑫益 180 天持有期债券 C 基金份额的销售服务费年费率为 0.2%，逐日计提，按月支付，日销售服务费=前一日分类基金资产净值×0.2%÷当年天数。

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

注：无。

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

注：无。

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

注：无。

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

注：无。

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

注：本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方没有投资及持有本基金份额。

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 4 月 21 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	25,250,677.44	26,788.95

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。本基金在上年度可比期间未成立。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

注：无。

6.4.11 利润分配情况

注：无。

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

注：无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 12,700,000.00 元，于 2026 年 07 月 01 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

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

本基金为债券型基金。本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、地方政府债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、公开发行的次级债、政府支持机构债）、股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会允许基金投资的股票）、存托凭证、港股通标的股票、资产支持证券、同业存单、债券回购、银行存款、国债期货、经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金（不包括 QDII 基金、香港互认基金、基金中基金、其他可投资公募基金的非基金中基金、货币市场基金、非本基金管理人管理的基金（全市场的股票型 ETF 除外））以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。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。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使

本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的风险管理组织架构。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制和合规审计委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策、协调突发重大风险等事项；督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中国证监会直接报告；在公司内部设立独立的监察稽核部，专职负责对基金管理人各部门、各业务的风险控制情况进行督促和检查，并适时提出整改建议。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去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同类风险损失的频度。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特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，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的发行人出现违约、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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行股份有限公司及其他具有基金托管资格的银行，与该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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。下列表格列示中不含国债、央行票据、政策性金融债券等非信用债券投资。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日
AAA	455,420,953.42
AAA 以下	—
未评级	100,942,433.97
合计	556,363,387.39

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构作出。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

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或于约定开放日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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大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，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。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。

于 2026 年 06 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额 12,700,000.00 元将在一个月内到期且计息

外，本基金所持有的全部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，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 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》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）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、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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“期末本基金持有的流通受限证券”。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。

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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款、结算备付金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。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。

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	25,250,677.44	-	-	-	25,250,677.44
结算备付金	569,769.11	-	-	-	569,769.11
存出保证金	42,381.69	-	-	-	42,381.69
交易性金融资产	324,800,735.33	21,218,896.44	240,658,525.48	53,774,355.08	640,452,512.33
资产总计	350,663,563.57	21,218,896.44	240,658,525.48	53,774,355.08	666,315,340.57
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	207,916.97	207,916.97
应付托管费	-	-	-	51,979.25	51,979.25
应付清算款	-	-	-	19,311,870.01	19,311,870.01
卖出回购金融资产款	12,700,000.00	-	-	-	12,700,000.00
应付销售服务费	-	-	-	20,296.97	20,296.97
应交税费	-	-	-	14,604.58	14,604.58
其他负债	-	-	-	80,980.47	80,980.47
负债总计	12,700,000.00	-	-	19,687,648.25	32,387,648.25
利率敏感度缺口	337,963,563.57	21,218,896.44	240,658,525.48	34,086,706.83	633,927,692.32

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	此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。
	该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风

	险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。	
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。	
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）
	市场利率下降 25 个基点	1,556,387.25
	市场利率上升 25 个基点	-1,546,763.47

注：无。

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。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

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证券投资品种，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。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%；股票、存托凭证、股票型基金、混合型基金等权益类资产、可转换债券及可交换债券资产的投资比例合计为基金资产的 5%-20%（其中，投资于境内股票资产的比

例不低于基金资产的 5%，投资于港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%）；本基金持有其他基金，其市值不超过基金资产净值的 10%；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，基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计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。其中，计入权益类资产的混合型基金需至少符合下列两个条件之一：

- 1、基金合同约定的股票及存托凭证资产投资比例不低于基金资产的 60%；
- 2、最近四个季度定期报告中披露的股票及存托凭证资产占基金资产比例均不低于 60%。

如果法律法规或监管机构对该比例要求有变更的，本基金在履行适当程序后以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。

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	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	53,774,355.08	8.48
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	53,774,355.08	8.48

注：债券投资为可转债、可交换债券投资。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2026 年 06 月 30 日，由于本基金运行期间不足一年，尚不存在足够的经验数据，因此，无法对本基金资产净值对于市场价格风险的敏感性作定量分析。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

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
第一层次	53,774,355.08
第二层次	586,678,157.25
第三层次	-
合计	640,452,512.33

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会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将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

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	53,774,355.08	8.07
	其中：股票	53,774,355.08	8.07
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	586,678,157.25	88.05
	其中：债券	586,678,157.25	88.05
	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	25,820,446.55	3.88
8	其他各项资产	42,381.69	0.01
9	合计	666,315,340.57	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	43,132.00	0.01
B	采矿业	1,628,750.00	0.26
C	制造业	36,378,582.48	5.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,355,318.00	0.37
E	建筑业	94,640.00	0.01
F	批发和零售业	393,217.00	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	685,551.00	0.11
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,018,632.60	0.79
J	金融业	3,623,436.00	0.57
K	房地产业	239,285.00	0.04
L	租赁和商务服务业	237,025.00	0.04
M	科学研究和技术服务业	1,070,887.00	0.17
N	水利、环境和公共设施管理业	847,550.00	0.13

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	258,876.00	0.04
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	845,773.00	0.13
S	综合	53,700.00	0.01
	合计	53,774,355.08	8.48

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

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	1,000	1,270,000.00	0.20
2	300750	宁德时代	2,300	903,923.00	0.14
3	300502	新易盛	1,400	849,800.00	0.13
4	600519	贵州茅台	600	711,294.00	0.11
5	600887	伊利股份	26,100	625,356.00	0.10
6	003816	中国广核	132,400	517,684.00	0.08
7	600276	恒瑞医药	9,900	515,196.00	0.08
8	300408	三环集团	3,000	500,700.00	0.08
9	600929	雪天盐业	105,900	480,786.00	0.08
10	688256	寒武纪	300	478,665.00	0.08
11	601318	中国平安	9,700	463,078.00	0.07
12	605077	华康股份	40,300	435,643.00	0.07
13	601858	中国科传	24,700	427,557.00	0.07
14	603259	药明康德	3,400	423,334.00	0.07
15	600201	生物股份	35,900	418,235.00	0.07
16	600000	浦发银行	47,900	412,419.00	0.07
17	002080	中材科技	4,400	396,000.00	0.06
18	600150	中国船舶	11,700	395,343.00	0.06
19	000338	潍柴动力	14,100	384,225.00	0.06
20	300604	长川科技	1,100	375,562.00	0.06
21	300857	协创数据	1,100	373,890.00	0.06
22	603315	福鞍股份	23,800	356,524.00	0.06
23	002158	汉钟精机	9,600	355,968.00	0.06
24	603063	禾望电气	6,700	354,363.00	0.06
25	688037	芯源微	800	351,240.00	0.06
26	300127	银河磁体	12,500	349,375.00	0.06
27	603228	景旺电子	4,800	347,568.00	0.05
28	000333	美的集团	4,600	347,438.00	0.05
29	600640	国脉文化	35,800	346,186.00	0.05

30	002615	哈尔斯	49,700	342,930.00	0.05
31	000779	甘咨询	43,600	339,644.00	0.05
32	000708	中信特钢	26,500	334,430.00	0.05
33	601601	中国太保	11,600	330,832.00	0.05
34	600176	中国巨石	4,500	327,960.00	0.05
35	301018	申菱环境	2,800	323,708.00	0.05
36	002396	星网锐捷	16,800	322,056.00	0.05
37	002353	杰瑞股份	2,100	320,250.00	0.05
38	603328	依顿电子	25,500	319,515.00	0.05
39	601899	紫金矿业	12,700	319,278.00	0.05
40	000935	四川双马	12,200	318,298.00	0.05
41	600166	福田汽车	109,300	318,063.00	0.05
42	688141	杰华特	2,000	307,000.00	0.05
43	002065	东华软件	42,000	299,880.00	0.05
44	601838	成都银行	16,900	299,130.00	0.05
45	603058	永吉股份	33,800	294,398.00	0.05
46	601985	中国核电	32,500	293,475.00	0.05
47	601998	中信银行	42,100	291,753.00	0.05
48	002895	川恒股份	9,900	289,080.00	0.05
49	601988	中国银行	50,300	287,716.00	0.05
50	301631	壹连科技	4,000	287,440.00	0.05
51	000967	盈峰环境	27,200	286,416.00	0.05
52	002484	江海股份	2,700	283,500.00	0.04
53	301051	信濠光电	14,600	283,240.00	0.04
54	002925	盈趣科技	11,400	281,124.00	0.04
55	688008	澜起科技	900	278,910.00	0.04
56	688213	思特威-W	2,600	278,382.00	0.04
57	600919	江苏银行	25,400	273,812.00	0.04
58	603033	三维股份	26,900	270,076.00	0.04
59	603258	电魂网络	21,900	262,581.00	0.04
60	000526	学大教育	10,200	258,876.00	0.04
61	600036	招商银行	7,100	252,050.00	0.04
62	688486	龙迅股份	3,900	247,962.00	0.04
63	688779	五矿新能	30,400	246,544.00	0.04
64	600292	电投水电	20,300	244,412.00	0.04
65	600886	国投电力	18,000	239,580.00	0.04
66	600690	海尔智家	11,700	238,797.00	0.04
67	603085	天成自控	21,600	234,792.00	0.04
68	301297	富乐德	3,800	232,712.00	0.04
69	688766	普冉股份	300	229,980.00	0.04
70	002912	中新赛克	12,400	228,656.00	0.04
71	601126	四方股份	3,600	227,520.00	0.04
72	601677	明泰铝业	13,600	225,760.00	0.04

73	603019	中科曙光	2,100	225,183.00	0.04
74	603612	索通发展	12,400	224,812.00	0.04
75	603993	洛阳钼业	12,600	221,130.00	0.03
76	300373	扬杰科技	1,400	220,122.00	0.03
77	000157	中联重科	31,400	218,858.00	0.03
78	688361	中科飞测	500	215,000.00	0.03
79	600409	三友化工	35,000	213,850.00	0.03
80	601882	海天精工	10,500	212,415.00	0.03
81	603025	大豪科技	15,400	210,056.00	0.03
82	301087	可孚医疗	4,400	209,660.00	0.03
83	600642	申能股份	23,900	208,647.00	0.03
84	600483	福能股份	20,400	207,876.00	0.03
85	600875	东方电气	7,100	204,267.00	0.03
86	600888	新疆众和	12,800	203,392.00	0.03
87	603806	福斯特	12,100	203,159.00	0.03
88	605011	杭州热电	13,100	202,526.00	0.03
89	002993	奥海科技	2,800	200,508.00	0.03
90	600318	新力金融	33,200	199,864.00	0.03
91	605286	同力天启	7,700	196,273.00	0.03
92	600115	中国东航	51,500	196,215.00	0.03
93	601939	建设银行	20,100	193,563.00	0.03
94	600011	华能国际	25,500	193,545.00	0.03
95	603977	国泰集团	11,700	193,167.00	0.03
96	688385	复旦微电	2,700	192,483.00	0.03
97	688111	金山办公	900	191,745.00	0.03
98	600183	生益科技	1,100	190,740.00	0.03
99	301095	广立微	1,600	188,880.00	0.03
100	002923	润都股份	19,740	186,740.40	0.03
101	688182	灿勤科技	4,300	185,201.00	0.03
102	688041	海光信息	500	185,150.00	0.03
103	000923	河钢资源	14,900	184,909.00	0.03
104	601168	西部矿业	6,700	181,838.00	0.03
105	600490	鹏欣资源	31,000	180,420.00	0.03
106	688235	百济神州	700	178,227.00	0.03
107	688252	天德钰	7,400	177,600.00	0.03
108	688127	蓝特光学	1,800	175,680.00	0.03
109	300274	阳光电源	1,100	174,922.00	0.03
110	600071	凤凰光学	10,200	174,726.00	0.03
111	601949	中国出版	37,400	173,910.00	0.03
112	605577	龙版传媒	19,200	169,152.00	0.03
113	688173	希荻微	8,800	168,432.00	0.03
114	688347	华虹宏力	500	168,150.00	0.03
115	603630	拉芳家化	13,100	167,418.00	0.03

116	300398	飞凯材料	2,700	166,725.00	0.03
117	600517	国网英大	35,600	166,608.00	0.03
118	300684	中石科技	2,700	164,700.00	0.03
119	000100	TCL 科技	28,200	164,124.00	0.03
120	600320	振华重工	39,500	163,135.00	0.03
121	603986	兆易创新	200	163,000.00	0.03
122	600637	东方明珠	19,400	161,214.00	0.03
123	601958	金钼股份	5,700	160,227.00	0.03
124	300687	赛意信息	5,100	158,100.00	0.02
125	688586	江航装备	13,500	157,815.00	0.02
126	301316	慧博云通	4,000	157,520.00	0.02
127	600674	川投能源	11,000	155,870.00	0.02
128	300673	佩蒂股份	11,200	150,640.00	0.02
129	002111	威海广泰	16,500	148,500.00	0.02
130	002539	云图控股	13,100	148,292.00	0.02
131	601766	中国中车	28,500	148,200.00	0.02
132	600685	中船防务	5,800	147,552.00	0.02
133	002536	飞龙股份	3,100	146,258.00	0.02
134	002444	巨星科技	4,600	143,060.00	0.02
135	002273	水晶光电	4,000	141,920.00	0.02
136	600556	天下秀	31,600	139,672.00	0.02
137	603268	松发股份	1,000	139,280.00	0.02
138	300619	金银河	4,420	137,506.20	0.02
139	000811	冰轮环境	2,400	134,928.00	0.02
140	002979	雷赛智能	2,400	133,872.00	0.02
141	600100	同方股份	19,400	132,890.00	0.02
142	601061	中信金属	12,300	132,471.00	0.02
143	300933	中辰股份	21,700	131,936.00	0.02
144	688150	莱特光电	1,900	130,378.00	0.02
145	301129	瑞纳智能	6,200	129,394.00	0.02
146	605218	伟时电子	7,800	128,934.00	0.02
147	300226	上海钢联	8,300	127,073.00	0.02
148	002803	吉宏股份	4,900	126,616.00	0.02
149	603699	纽威股份	2,500	125,750.00	0.02
150	688352	颀中科技	5,200	125,736.00	0.02
151	300842	帝科股份	1,400	124,838.00	0.02
152	600098	广州发展	21,100	124,701.00	0.02
153	600489	中金黄金	6,900	124,545.00	0.02
154	688159	有方科技	2,800	124,292.00	0.02
155	301117	佳缘科技	5,300	123,755.00	0.02
156	300446	航天智造	7,300	122,859.00	0.02
157	601816	京沪高铁	26,900	121,857.00	0.02
158	301468	博盈特焊	2,900	120,959.00	0.02

159	002518	科士达	2,200	117,898.00	0.02
160	603118	共进股份	9,500	115,045.00	0.02
161	000589	贵州轮胎	28,000	113,680.00	0.02
162	300548	长芯博创	400	111,200.00	0.02
163	300862	蓝盾光电	5,300	110,452.00	0.02
164	002913	奥士康	1,700	108,698.00	0.02
165	605376	博迁新材	400	108,520.00	0.02
166	603737	三棵树	4,500	108,450.00	0.02
167	002258	利尔化学	8,500	108,035.00	0.02
168	688123	聚辰股份	500	106,300.00	0.02
169	002064	华峰化学	11,200	106,288.00	0.02
170	002266	浙富控股	20,800	105,248.00	0.02
171	002008	大族激光	700	105,077.00	0.02
172	603108	润达医疗	11,700	104,130.00	0.02
173	000902	新洋丰	9,000	104,040.00	0.02
174	300285	国瓷材料	1,000	103,180.00	0.02
175	301180	万祥科技	8,200	102,746.00	0.02
176	603633	徕木股份	15,000	102,150.00	0.02
177	300006	莱美药业	19,900	102,087.00	0.02
178	603950	长源东谷	1,200	101,316.00	0.02
179	688027	国盾量子	200	100,802.00	0.02
180	603286	日盈电子	2,200	100,386.00	0.02
181	603588	高能环境	5,200	99,840.00	0.02
182	600362	江西铜业	2,300	99,590.00	0.02
183	300820	英杰电气	1,100	99,253.00	0.02
184	688525	佰维存储	200	98,946.00	0.02
185	002475	立讯精密	1,400	98,560.00	0.02
186	688191	智洋创新	2,740	97,818.00	0.02
187	688120	华海清科	300	96,654.00	0.02
188	600266	城建发展	24,400	95,404.00	0.02
189	601156	东航物流	5,900	95,108.00	0.02
190	002938	鹏鼎控股	900	94,842.00	0.01
191	001309	德明利	100	94,290.00	0.01
192	600461	洪城环境	10,300	93,318.00	0.01
193	688099	晶晨股份	900	92,610.00	0.01
194	603698	航天工程	2,400	92,544.00	0.01
195	603355	莱克电气	3,500	92,330.00	0.01
196	300113	顺网科技	5,000	91,050.00	0.01
197	600391	航发科技	2,700	90,315.00	0.01
198	688584	上海合晶	2,500	89,875.00	0.01
199	600416	湘电股份	9,100	89,180.00	0.01
200	300257	开山股份	3,100	88,908.00	0.01
201	601020	华钰矿业	3,700	88,763.00	0.01

202	600361	创新新材	24,600	88,560.00	0.01
203	300672	国科微	300	88,500.00	0.01
204	301251	威尔高	1,640	87,379.20	0.01
205	688052	纳芯微	300	86,493.00	0.01
206	300905	宝丽迪	1,700	86,020.00	0.01
207	301153	中科江南	5,200	84,708.00	0.01
208	300982	苏文电能	5,600	84,616.00	0.01
209	601872	招商轮船	4,800	84,336.00	0.01
210	688639	华恒生物	5,200	83,928.00	0.01
211	688126	沪硅产业	2,100	83,769.00	0.01
212	300711	广哈通信	5,100	83,640.00	0.01
213	603386	骏亚科技	4,200	82,866.00	0.01
214	603395	红四方	4,100	82,000.00	0.01
215	600552	凯盛科技	2,500	81,450.00	0.01
216	688503	聚和材料	600	79,620.00	0.01
217	600026	中远海能	4,400	78,936.00	0.01
218	002384	东山精密	300	78,705.00	0.01
219	688772	珠海冠宇	4,000	78,520.00	0.01
220	300806	斯迪克	700	78,400.00	0.01
221	300183	东软载波	7,500	78,375.00	0.01
222	600352	浙江龙盛	6,400	77,504.00	0.01
223	600105	永鼎股份	1,141	76,994.68	0.01
224	002666	德联集团	19,200	75,840.00	0.01
225	002654	万润科技	3,400	75,684.00	0.01
226	688668	鼎通科技	200	74,660.00	0.01
227	605222	起帆电缆	3,200	74,624.00	0.01
228	600446	金证股份	7,400	74,444.00	0.01
229	601155	新城控股	7,200	73,872.00	0.01
230	002046	国机精工	1,000	73,650.00	0.01
231	002815	崇达技术	4,400	72,996.00	0.01
232	301221	光庭信息	2,460	72,594.60	0.01
233	000426	兴业银锡	2,200	72,512.00	0.01
234	603878	武进不锈	13,900	71,446.00	0.01
235	001389	广合科技	300	71,175.00	0.01
236	603915	国茂股份	5,000	70,950.00	0.01
237	601688	华泰证券	3,400	70,108.00	0.01
238	300919	中伟新材	1,600	70,000.00	0.01
239	601825	沪农商行	9,300	69,657.00	0.01
240	300476	胜宏科技	200	69,286.00	0.01
241	601333	广深铁路	24,700	67,925.00	0.01
242	603273	天元智能	5,200	67,340.00	0.01
243	301205	联特科技	200	66,820.00	0.01
244	301085	亚康股份	1,100	66,671.00	0.01

245	300236	上海新阳	500	65,750.00	0.01
246	301029	怡合达	2,400	64,824.00	0.01
247	603158	腾龙股份	5,300	64,819.00	0.01
248	601699	潞安环能	4,500	64,260.00	0.01
249	300447	全信股份	4,300	64,199.00	0.01
250	300365	恒华科技	14,000	64,120.00	0.01
251	300942	易瑞生物	10,800	62,424.00	0.01
252	688220	翱捷科技-U	500	62,160.00	0.01
253	603013	亚普股份	3,900	61,581.00	0.01
254	000922	佳电股份	4,400	61,424.00	0.01
255	301622	英思特	1,300	61,230.00	0.01
256	605378	野马电池	4,400	60,984.00	0.01
257	300777	中简科技	2,300	60,444.00	0.01
258	002929	润建股份	900	60,192.00	0.01
259	603291	联合水务	7,400	59,496.00	0.01
260	600328	中盐化工	9,900	59,400.00	0.01
261	688107	安路科技	1,300	59,280.00	0.01
262	301511	德福科技	400	57,540.00	0.01
263	300522	世名科技	2,400	57,528.00	0.01
264	688590	新致软件	4,600	57,178.00	0.01
265	002001	新和成	2,000	56,840.00	0.01
266	688372	伟测科技	300	55,800.00	0.01
267	000532	华金资本	5,000	53,700.00	0.01
268	002025	航天电器	700	53,354.00	0.01
269	002947	恒铭达	700	53,235.00	0.01
270	300504	天邑股份	3,300	53,229.00	0.01
271	002155	湖南黄金	2,200	52,514.00	0.01
272	603897	长城科技	1,600	51,936.00	0.01
273	002545	东方铁塔	3,200	51,904.00	0.01
274	301391	卡莱特	900	51,390.00	0.01
275	002497	雅化集团	2,500	50,925.00	0.01
276	601801	皖新传媒	10,300	50,779.00	0.01
277	600926	杭州银行	3,500	50,575.00	0.01
278	002683	广东宏大	1,700	49,793.00	0.01
279	002636	金安国纪	400	47,988.00	0.01
280	600783	鲁信创投	2,400	47,808.00	0.01
281	688351	微电生理	2,100	47,586.00	0.01
282	603179	新泉股份	940	46,671.00	0.01
283	600206	有研新材	700	46,620.00	0.01
284	002916	深南电路	100	45,790.00	0.01
285	002125	湘潭电化	3,200	43,712.00	0.01
286	688209	英集芯	1,500	43,620.00	0.01
287	603799	华友钴业	900	43,434.00	0.01

288	601398	工商银行	6,100	43,127.00	0.01
289	300661	圣邦股份	300	43,044.00	0.01
290	600389	江山股份	2,200	42,944.00	0.01
291	600295	鄂尔多斯	4,000	42,880.00	0.01
292	603613	国联股份	2,300	42,366.00	0.01
293	601336	新华保险	700	41,762.00	0.01
294	002142	宁波银行	1,400	41,566.00	0.01
295	603568	伟明环保	2,700	41,526.00	0.01
296	600885	宏发股份	1,200	41,388.00	0.01
297	688660	电气风电	4,800	41,376.00	0.01
298	603688	石英股份	500	41,305.00	0.01
299	300479	神思电子	3,000	40,620.00	0.01
300	603516	淳中科技	300	40,383.00	0.01
301	688799	华纳药厂	900	40,383.00	0.01
302	688516	奥特维	700	40,173.00	0.01
303	688007	光峰科技	3,000	39,900.00	0.01
304	603383	顶点软件	1,500	39,840.00	0.01
305	300389	艾比森	3,100	39,742.00	0.01
306	603885	吉祥航空	3,800	39,102.00	0.01
307	002016	世荣兆业	9,400	37,600.00	0.01
308	300151	昌红科技	1,500	37,425.00	0.01
309	300747	锐科激光	700	37,163.00	0.01
310	601665	齐鲁银行	6,400	36,928.00	0.01
311	301479	弘景光电	600	36,120.00	0.01
312	300130	新国都	1,700	35,768.00	0.01
313	000534	万泽股份	1,300	35,568.00	0.01
314	603317	天味食品	2,700	35,127.00	0.01
315	300781	因赛集团	1,300	34,268.00	0.01
316	600618	氯碱化工	3,400	34,170.00	0.01
317	002852	道道全	4,800	34,032.00	0.01
318	002563	森马服饰	6,600	33,264.00	0.01
319	603050	科林电气	1,700	33,252.00	0.01
320	002632	道明光学	3,600	32,436.00	0.01
321	000001	平安银行	3,200	32,160.00	0.01
322	688153	唯捷创芯	1,000	32,120.00	0.01
323	688981	中芯国际	200	31,764.00	0.01
324	600499	科达制造	2,300	31,740.00	0.01
325	688097	博众精工	500	31,525.00	0.00
326	688375	国博电子	300	31,290.00	0.00
327	300260	新莱应材	300	30,138.00	0.00
328	300475	香农芯创	100	30,000.00	0.00
329	603507	振江股份	900	29,601.00	0.00
330	000598	兴蓉环境	4,600	29,532.00	0.00

331	002782	可立克	1,400	29,470.00	0.00
332	300381	溢多利	5,200	29,224.00	0.00
333	605123	派克新材	300	29,103.00	0.00
334	600167	联美控股	5,200	29,068.00	0.00
335	600596	新安股份	1,800	28,728.00	0.00
336	688318	财富趋势	400	28,524.00	0.00
337	300855	图南股份	900	28,134.00	0.00
338	002960	青鸟智控	3,300	27,951.00	0.00
339	600761	安徽合力	1,600	26,176.00	0.00
340	603338	浙江鼎力	600	25,500.00	0.00
341	605399	晨光新材	1,700	24,973.00	0.00
342	603219	富佳股份	1,600	24,928.00	0.00
343	688136	科兴制药	1,200	24,852.00	0.00
344	002317	众生药业	1,000	24,570.00	0.00
345	301031	中熔电气	200	23,890.00	0.00
346	603016	新宏泰	700	23,632.00	0.00
347	002716	湖南白银	2,900	23,461.00	0.00
348	601088	中国神华	600	23,424.00	0.00
349	605116	奥锐特	1,200	22,704.00	0.00
350	603960	克来机电	1,300	22,633.00	0.00
351	002734	利民股份	1,300	22,321.00	0.00
352	002138	顺络电子	300	21,930.00	0.00
353	300782	卓胜微	200	21,916.00	0.00
354	603848	好太太	1,600	21,856.00	0.00
355	001979	招商蛇口	3,300	21,219.00	0.00
356	601101	昊华能源	2,000	21,120.00	0.00
357	600988	赤峰黄金	800	21,056.00	0.00
358	300124	汇川技术	300	19,899.00	0.00
359	300232	洲明科技	3,400	19,482.00	0.00
360	688179	阿拉丁	700	19,397.00	0.00
361	603009	北特科技	400	19,188.00	0.00
362	000166	申万宏源	4,300	18,920.00	0.00
363	600467	好当家	9,600	18,912.00	0.00
364	600330	天通股份	600	18,504.00	0.00
365	603381	永臻股份	1,200	18,492.00	0.00
366	688700	东威科技	200	17,880.00	0.00
367	603615	茶花股份	1,100	17,765.00	0.00
368	605060	联德股份	300	17,022.00	0.00
369	688172	燕东微	200	16,732.00	0.00
370	300523	辰安科技	900	16,542.00	0.00
371	300134	大富科技	1,800	15,390.00	0.00
372	300659	中孚信息	1,600	15,200.00	0.00
373	000931	中关村	3,600	14,796.00	0.00

374	688006	杭可科技	400	14,620.00	0.00
375	002011	盾安环境	1,300	13,793.00	0.00
376	000975	山金国际	800	13,600.00	0.00
377	688690	纳微科技	300	13,230.00	0.00
378	002458	益生股份	1,700	13,209.00	0.00
379	300025	华星创业	3,100	13,020.00	0.00
380	301172	君逸数码	500	12,975.00	0.00
381	688226	威腾电气	300	12,849.00	0.00
382	301025	读客文化	1,600	12,416.00	0.00
383	688518	联赢激光	400	12,360.00	0.00
384	600872	中炬高新	700	12,152.00	0.00
385	603979	金诚信	200	11,806.00	0.00
386	600131	国网信通	800	11,680.00	0.00
387	688593	新相微	300	11,676.00	0.00
388	002644	佛慈制药	1,700	11,577.00	0.00
389	600510	黑牡丹	1,500	11,190.00	0.00
390	002624	完美世界	900	11,178.00	0.00
391	000050	深天马 A	1,100	10,901.00	0.00
392	603005	晶方科技	200	10,774.00	0.00
393	002415	海康威视	300	10,260.00	0.00
394	300602	飞荣达	200	10,240.00	0.00
395	002772	众兴菌业	900	10,224.00	0.00
396	002062	宏润建设	1,400	10,024.00	0.00
397	601399	国机重装	2,800	9,800.00	0.00
398	300510	金冠股份	3,100	9,672.00	0.00
399	603920	世运电路	200	9,608.00	0.00
400	601918	新集能源	1,100	9,449.00	0.00
401	603175	超颖电子	100	8,909.00	0.00
402	601898	中煤能源	700	8,526.00	0.00
403	601928	凤凰传媒	900	7,911.00	0.00
404	600346	恒力石化	400	7,084.00	0.00
405	300689	澄天伟业	100	7,018.00	0.00
406	300769	德方纳米	100	6,650.00	0.00
407	000810	创维数字	500	6,625.00	0.00
408	002324	普利特	500	6,035.00	0.00
409	300768	迪普科技	400	5,508.00	0.00
410	300322	硕贝德	200	5,040.00	0.00
411	600497	驰宏锌锗	400	4,844.00	0.00
412	301382	蜂助手	100	4,600.00	0.00
413	300787	海能实业	500	4,560.00	0.00
414	600353	旭光电子	100	4,560.00	0.00
415	300426	华智数媒	800	4,048.00	0.00
416	600171	上海贝岭	100	3,194.00	0.00

417	301510	固高科技	100	3,193.00	0.00
418	600459	贵研铂业	100	2,888.00	0.00
419	600029	南方航空	400	2,072.00	0.00
420	300986	志特新材	100	1,715.00	0.00
421	600746	江苏索普	200	1,046.00	0.00
422	300231	银信科技	100	795.00	0.00
423	002041	登海种业	100	787.00	0.00
424	600282	南钢股份	100	459.00	0.00
425	600963	岳阳林纸	100	304.00	0.00
426	601599	浙文影业	100	279.00	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	300750	宁德时代	1,294,314.00	0.20
2	600519	贵州茅台	1,177,480.00	0.19
3	300308	中际旭创	1,100,394.00	0.17
4	601318	中国平安	940,741.00	0.15
5	000333	美的集团	751,224.00	0.12
6	300502	新易盛	677,017.00	0.11
7	600887	伊利股份	657,486.00	0.10
8	688256	寒武纪	643,820.00	0.10
9	600276	恒瑞医药	626,282.00	0.10
10	003816	中国广核	593,547.00	0.09
11	600919	江苏银行	582,623.00	0.09
12	605077	华康股份	566,402.00	0.09
13	600929	雪天盐业	538,757.00	0.08
14	601858	中国科传	506,076.00	0.08
15	688213	思特威-W	497,684.86	0.08
16	605286	同力天启	485,081.00	0.08
17	605011	杭州热电	481,598.00	0.08
18	002484	江海股份	480,601.00	0.08
19	600483	福能股份	474,385.00	0.07
20	600000	浦发银行	471,607.00	0.07

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	300319	麦捷科技	400,071.00	0.06
2	002484	江海股份	362,007.00	0.06
3	000333	美的集团	361,595.00	0.06
4	600519	贵州茅台	357,282.00	0.06

5	688498	源杰科技	340,868.00	0.05
6	601318	中国平安	339,334.00	0.05
7	300750	宁德时代	313,011.00	0.05
8	688037	芯源微	309,385.41	0.05
9	601211	国泰海通	307,959.00	0.05
10	688256	寒武纪	292,422.00	0.05
11	688766	普冉股份	289,436.00	0.05
12	300568	星源材质	283,138.00	0.04
13	600919	江苏银行	282,961.00	0.04
14	688213	思特威-W	260,848.51	0.04
15	002138	顺络电子	257,167.00	0.04
16	002273	水晶光电	243,426.00	0.04
17	688772	珠海冠宇	241,710.83	0.04
18	300656	民德电子	228,728.00	0.04
19	002011	盾安环境	225,001.00	0.04
20	601677	明泰铝业	223,036.00	0.04

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	85,022,655.86
卖出股票收入（成交）总额	32,159,774.14

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	30,314,769.86	4.78
2	央行票据	-	-
3	金融债券	313,189,273.97	49.40
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	243,174,113.42	38.36
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	586,678,157.25	92.55

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	公允价值	占基金资产净值比例
----	------	------	----	------	-----------

			(张)		(%)
1	2128025	21 建设银行 二级 01	500,000	51,643,767.12	8.15
2	2228001	22 邮储银行 永续债 01	500,000	51,311,852.05	8.09
3	232380089	23 中信银行 二级资本债 01A	400,000	42,190,562.19	6.66
4	232380006	23 中行二级 资本债 01A	400,000	41,697,032.33	6.58
5	240850	24 中电 02	400,000	40,424,960.00	6.38

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

注：无。

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

注：无。

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

注：无。

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

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

7.10.2 本期国债期货投资评价

无。

7.11 本报告期投资基金情况

7.11.1 投资政策及风险说明

无。

7.11.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有基金投资明细

注：无。

7.11.3 报告期末基金持有的全部公开募集不动产投资信托基金情况

注：无。

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

交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局、中国人民银行的处罚。

招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局的处罚。

浙商银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局、中国人民银行的处罚。

中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局、中国人民银行的处罚。

中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局的处罚。

中国邮政储蓄银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局的处罚。

中信银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局、国家金融监管总局云南监管局、中国人民银行的处罚。

以上证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

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	42,381.69
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	42,381.69

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

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，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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 (%)
鹏华瑞衡 鑫益 180 天持有期 债券 A	1,502	338,659.47	11,468,982.61	2.25	497,197,545.86	97.75
鹏华瑞衡 鑫益 180 天持有期 债券 C	797	154,885.27	0.00	0.00	123,443,560.73	100.00
合计	2,299	274,950.02	11,468,982.61	1.81	620,641,106.59	98.19

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：截至本报告期末，本基金管理人所有从业人员未持有本基金份额。

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

注：截至本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金的基金经理未持有本基金份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鹏华瑞衡鑫益 180 天持有期债券 A	鹏华瑞衡鑫益 180 天持有期债券 C
基金合同生效日 (2026 年 4 月 21 日) 基金份额总额	508,666,528.47	123,443,560.73
基金合同生效日起 至报告期期末基金 总申购份额	—	—
减：基金合同生效 日起至报告期期末 基金总赎回份额	—	—
基金合同生效日起 至报告期期末基金 拆分变动份额	—	—

本报告期末基金份额总额	508,666,528.47	123,443,560.73
-------------	----------------	----------------

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

基金管理人的重大人事变动：

报告期内，公司原副总经理李伟先生因个人原因辞职，经公司第六届董事会第三百三十八次会议审议通过，自 2026 年 4 月 3 日起，李伟先生不再担任公司副总经理。

本公司已将上述变更事项报中国证券监督管理委员会深圳监管局备案。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

无。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金管理人聘请毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金审计的会计师事务所。本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.7.1 管理人受调查或处罚等情况

注：无。

10.7.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：无。

10.7.3 托管人受调查或处罚等情况

注：无。

10.7.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：无。

10.8 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.8.1 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(%)	
申万宏源证券	3	30,123,952.33	25.71	13,583.77	25.71	本报告期新增
汇丰前海证券	1	23,334,255.50	19.91	10,520.79	19.91	本报告期新增
中金公司	1	22,071,629.70	18.84	9,952.45	18.84	本报告期新增
广发证券	1	15,288,080.72	13.05	6,893.92	13.05	本报告期新增
中信证券	1	14,653,379.90	12.50	6,607.91	12.51	本报告期新增
国金证券	1	11,711,131.85	9.99	5,279.55	9.99	本报告期新增
长江证券	1	—	—	—	—	本报告期新增
东方证券	1	—	—	—	—	本报告期新增
东吴证券	1	—	—	—	—	本报告期新增
东兴证券	1	—	—	—	—	本报告期新增
光大证券	1	—	—	—	—	本报告期新增

国泰海通 证券	1	-	-	-	-	本 报 告 期 新 增
国投证券	1	-	-	-	-	本 报 告 期 新 增
华泰证券	1	-	-	-	-	本 报 告 期 新 增
太平洋证 券	1	-	-	-	-	本 报 告 期 新 增
西南证券	1	-	-	-	-	本 报 告 期 新 增
信达证券	1	-	-	-	-	本 报 告 期 新 增
银河证券	1	-	-	-	-	本 报 告 期 新 增
浙商证券	1	-	-	-	-	本 报 告 期 新 增
中信建投 证券	1	-	-	-	-	本 报 告 期 新 增

注：交易单元选择的标准和程序：

1. 根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（以下简称《规定》），基金管理人制定了相应的管理制度规范交易单元选择的标准和程序。基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券公司，选择标准包括：财务状况良好，经营行为规范；有完备的合规管理流程和制度，风险控制能力较强；研究、交易等服务能力较强，交易设施能够为投资组合提供有效的交易执行；中国证监会或有权机关规定的其他条件等。

2. 选择程序如下：

- （1）基金管理人根据上述标准评估并确定选用的证券公司；
- （2）基金管理人与提供证券交易服务的证券公司签订协议，并办理开立交易账户等事宜；
- （3）基金管理人定期对证券公司进行评价，依据评价结果选择交易单元。

3. 根据《规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率；其他类型基金股票交易佣金费率原则上不得超

过市场平均股票交易佣金费率的两倍。

10.8.2 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		基金交易	
	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 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
申万宏源证券	-	-	83,200,000.00	5.62	-	-	-	-
汇丰前海证券	-	-	75,200,000.00	5.08	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	30,105,721.00	6.37	-	-	-	-	-	-
国金	442,442,637.00	93.63	1,323,000,000.00	89.31	-	-	-	-

证 券								
长 江 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
东 方 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
东 吴 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
东 兴 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
光 大 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国 泰 海 通 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国 投 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华 泰 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
太 平 洋 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
西 南 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-

信达 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 建投 证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.9 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	鹏华瑞衡鑫益 180 天持有期债券型证券投资基金基金份额发售公告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 03 月 26 日
2	鹏华瑞衡鑫益 180 天持有期债券型证券投资基金基金合同	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 03 月 26 日
3	鹏华瑞衡鑫益 180 天持有期债券型证券投资基金托管协议	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 03 月 26 日
4	鹏华瑞衡鑫益 180 天持有期债券型证券投资基金招募说明书	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 03 月 26 日
5	鹏华瑞衡鑫益 180 天持有期债券型证券投资基金（A 类基金份额）基金产品资料概要	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 03 月 26 日
6	鹏华瑞衡鑫益 180 天持有期债券型证券投资基金（C 类基金份额）基金产品资料概要	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 03 月 26 日

7	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与海南有知有行基金销售有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 03 月 31 日
8	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 04 月 04 日
9	鹏华基金管理有限公司关于暂停客服电话服务的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 04 月 17 日
10	鹏华瑞衡鑫益 180 天持有期债券型证券投资基金基金合同生效公告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 04 月 22 日
11	鹏华基金管理有限公司关于终止中证金牛(北京)基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 05 月 30 日
12	鹏华基金管理有限公司关于终止浦领基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 06 月 24 日

注：无。

§ 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

注：无。

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

- （一）《鹏华瑞衡鑫益 180 天持有期债券型证券投资基金基金合同》；
- （二）《鹏华瑞衡鑫益 180 天持有期债券型证券投资基金托管协议》；
- （三）《鹏华瑞衡鑫益 180 天持有期债券型证券投资基金 2026 年中期报告》（原文）。

12.2 存放地点

深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司。

12.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站（<http://www.phfund.com.cn>）查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司，本公司已开通客户服务系统，咨询电话：400-6788-533。

鹏华基金管理有限公司

2026 年 8 月 28 日