

新华锦利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：新华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年八月二十八日

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。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 3 月 27 日(基金合同生效日)起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	45
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	46
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	46
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	46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12 投资组合报告附注	46
8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
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的情况	48
9 开放式基金份额变动	48
10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
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	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4 基金投资策略的改变	49
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	49
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	49
10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	49
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	49
10.9 其他重大事件	50
11 影响投资者决策的其他重要信息	51
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	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	51
12 备查文件目录	51
12.1 备查文件目录	51
12.2 存放地点	52
12.3 查阅方式	52

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	新华锦利债券型证券投资基金	
基金简称	新华锦利债券	
基金主代码	026307	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2026 年 3 月 27 日	
基金管理人	新华基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	49,444,113.19 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	新华锦利债券 A	新华锦利债券 C
下属分级基金的交易代码	026307	026308
报告期末下属分级基金的份额总额	33,739,892.48 份	15,704,220.71 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制投资组合风险的前提下，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金的投资策略包括：大类资产配置策略、债券投资策略、股票投资策略。
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率×80%+中证 800 指数收益率×18%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*2%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期收益和风险水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金若投资港股通标的股票，则需承担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		新华基金管理股份有限公司	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	齐岩	张立学
	联系电话	010-68779688	010-68858126
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	zhanglixue@psbcoa.com.cn
客户服务电话		4008198866	95580
传真		010-68779528	010-86353609
注册地址		重庆市江北区聚贤岩广场6号	北京市西城区金融大街3号

	力帆中心2号楼19层	
办公地址	重庆市江北区聚贤岩广场6号 力帆中心2号楼19层,北京市西城区平安里西大街26号新时代大厦9层、11层	北京市西城区金融大街3号A座
邮政编码	400010	100808
法定代表人	银国宏	郑国雨

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
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.ncfund.com.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人、基金托管人的办公地

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	新华基金管理股份有限公司	重庆市江北区聚贤岩广场 6 号力帆中心 2 号楼 19 层

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 3 月 27 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日)	
	新华锦利债券 A	新华锦利债券 C
本期已实现收益	614,518.04	303,513.98
本期利润	1,105,927.98	516,141.57
加权平均基金份额本期利润	0.0132	0.0081
本期加权平均净值利润率	1.32%	0.81%
本期基金份额净值增长率	2.23%	2.18%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	新华锦利债券 A	新华锦利债券 C
期末可供分配利润	426,926.51	191,176.92
期末可供分配基金份额利润	0.0127	0.0122
期末基金资产净值	34,492,543.85	16,046,951.07
期末基金份额净值	1.0223	1.0218
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	新华锦利债券 A	新华锦利债券 C

基金份额累计净值增长率	2.23%	2.18%
-------------	-------	-------

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；

2、以上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（例如基金申购费赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

新华锦利债券 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	2.23%	0.15%	2.74%	0.26%	-0.51%	-0.11%
自基金合同生效起至今	2.23%	0.15%	2.70%	0.26%	-0.47%	-0.11%

新华锦利债券 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
过去三个月	2.18%	0.15%	2.74%	0.26%	-0.56%	-0.11%
自基金合同生效起至今	2.18%	0.15%	2.70%	0.26%	-0.52%	-0.11%

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

新华锦利债券型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2026 年 3 月 27 日至 2026 年 6 月 30 日)

新华锦利债券 A



新华锦利债券 C



注：1、本基金合同于 2026 年 3 月 27 日生效，截至本报告期末基金合同生效未满一年。

2、自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，截至本报告期末基金建仓期尚未结束。

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

新华基金管理股份有限公司经中国证券监督管理委员会批复，于 2004 年 12 月 9 日注册成立。注册地为重庆市，是我国西部首家公募基金管理公司。

截至 2026 年 6 月 30 日，新华基金管理股份有限公司旗下管理着五十五只开放式基金，即新华优选分红混合型证券投资基金、新华优选成长混合型证券投资基金、新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金、新华钻石品质企业混合型证券投资基金、新华行业周期轮换混合型证券投资基金、新华中小市值优选混合型证券投资基金、新华优选消费混合型证券投资基金、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金、新华趋势领航混合型证券投资基金、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金、新华壹诺宝货币市场基金、新华增怡债券型证券投资基金、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金、新华中证环保产业指数证券投资基金、新华活期添利货币市场基金、新华增盈回报债券型证券投资基金、新华策略精选股票型证券投资基金、新华稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金、新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫回报混合型证券投资基金、新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金、新华科技创新主题灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金、新华双利债券型证券投资基金、新华丰利债券型证券投资基金、新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金、新华红利回报混合型证券投资基金、新华安享多裕定期开放灵活配置混合型证券投资基金、新华恒稳添利债券型证券投资基金、新华鑫日享中短债债券型证券投资基金、新华聚利债券型证券投资基金、新华鼎利债券型证券投资基金、新华沪深 300 指数增强型证券投资基金、新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金、新华景气行业混合型证券投资基金、新华安享惠融 88 个月定期开放债券型证券投资基金、新华利率债债券型证券投资基金、新华行业龙头主题股票型证券投资基金、新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金、新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金、新华中债 1-5 年农发行债券指数证券投资基金、新华中债 0-3 年政策性金融债指数证券投资基金、新华中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金、新华中证 A500 指数增强型证券投资基金、新华中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、新华科技优选混合型发起式证券投资基金、新华低碳经济混合型发起式证券投资基金、新华医疗创新混合型发起式证券投资基金、新华大盘成长量化选股混合型发起式证券投资基金、新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、新华锦利债券型证券投资基金、新华科技甄选混合型发起式证券投资基金、新华数字经

济混合型发起式证券投资基金、新华中证科创创业 50 指数型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
林翟	本基金基金经理，新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华双利债券型证券投资基金基金经理、新华行业龙头主题股票型证券投资基金基金经理、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华鼎利债券型证券投资基金基金经理、新华大盘成长量化选股混合型发起式证券投资基金基金经理。	2026-03-27	-	16	金融工程硕士，曾任华农财产保险股份有限公司投资经理、中英人寿保险有限公司投资经理、新时代证券股份有限公司高级投资经理、北信瑞丰基金管理有限公司基金经理。
姚海明	本基金基金经理，固定收益投资部副总监（主持工作），新华聚利债券型证券投资基金基金经理、新华红利回报混合型证券投资基金基金经理、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金基金经	2026-03-27	-	12	会计学硕士，曾任中国工商银行总行资产管理部交易员，新华基金固定收益与平衡投资部债券研究员、基金经理助理、投资经理。

	理、新华安享惠融 88 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。				
--	----------------------------------	--	--	--	--

注：1、首任基金经理，任职日期指基金合同生效日，离任日期指根据公司决定确定的解聘日期。

2、非首任基金经理，任职日期和离任日期均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

3、证券从业的含义遵从《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》、《基金从业人员管理规则》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

本报告期末不存在基金经理同时兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

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，新华基金管理股份有限公司作为新华锦利债券型证券投资基金的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华锦利债券型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

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

本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度，通过制度、流程、系统和技术手段落实公平交易原则，公平对待旗下管理的所有投资组合。本报告期，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规或对基金财产造成损失的异常交易行为；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，未发生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%情形。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年中东地缘反复扰动航运与油价，中断全球通胀下行节奏，欧美通胀粘性抬升，美

联储维持高利率，年内降息预期基本消退，加息预期升温，美元走强压制全球流动性，AI 资本开支持续高增，科技板块阶段性领涨后二季度末估值回调，全球市场持续受高利率与地缘风险双重压制。上半年国内经济整体平稳、结构性分化明显，二季度 PMI 逐月回升至荣枯线以上，货币政策维持稳健偏宽松，灵活投放对冲资金波动，M2 保持平稳但信贷传导偏弱。CPI 温和回升、PPI 小幅转正，进出口韧性突出，AI 硬件、机器人、机电成为外贸新引擎。高新制造投资托底、地产持续拖累，企业盈利 K 型分化，科技产业利润高增，传统行业承压，内需修复力度不足，经济依靠外需与新动能支撑。

2026 年上半年 A 股整体是“宽货币+科技叙事+产业景气”三重驱动下的结构性行情，走势上呈现震荡上行、节奏先扬后抑再冲高，科创 50、创业板大幅领涨，沪指小幅收涨，资金面两融破 3 万亿，日均 2.74 万亿近乎翻倍。算力、半导体、光模块等 AI 硬件贯穿全年主线，订单与业绩持续兑现，资金抱团高位成长，消费、地产、金融等传统板块持续走弱。二季度末赛道拥挤度抬升，市场交易热度居高不下，赚指数不赚个股特征突出。报告期内，本基金股票逐步建仓，投资仓位维持低位，对于持仓股票的基本面和业绩确定性要求比较高，重点在科技成长、资源龙头和出海等方向展开配置。

2026 年上半年债市整体震荡走牛，曲线呈牛陡格局，货币维持适度宽松，资金中枢平稳低位，资产荒持续支撑配置需求。一季度超长债供给、地缘油价扰动带来阶段性调整，二季度内需修复偏弱、信贷需求不足推动长端利率持续下行，10 年期国债收益率较年初明显回落，短端表现更强。上半年信用债分层分化加剧，高等级利差持续压缩，弱区域、地产相关低评级品种承压。上半年特别国债和地方债集中发行阶段性压制长端，机构整体以中短久期配置为主，6 月跨季资金收紧、经济边际回暖引发短期震荡，美债高位运行持续约束长久期做多空间。机构行为方面，大行买短卖长压力缓解，小行降久期止盈，保险平配长久期地方债，基金右侧拉久期。报告期内，本基金债券投资以利率债为主要持仓，组合久期较低，以获取票息收益为主，保持组合较高流动性。

2026 年上半年中证转债指数呈 N 型震荡上行，市场存量持续收缩，成交同比显著放量，整体转股溢价率处于历史高位。行情极致分化，算力、半导体等高景气科技转债持续领涨，传统地产、低评级产业转债走势疲软；上半年强赎频发压制高价券弹性，6 月权益回调带动高溢价品种大幅回撤，机构减持高价抱团标的，转向均衡中低价券布局，交易属性显著增强，机构从“配置驱动”切“交易驱动”，强赎定价有所前置，下修博弈超额收益衰减，债底仅为低波动品种提供相对有限防御支撑。报告期内，本基金转债仓位较低，尚处于建仓过程。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 1.0223 元，本报告期份额净值增长率为 2.23%，同期业绩比较基准收益率为 2.70%；C 类基金份额净值为 1.0218 元，本报告期份额净值增长率为 2.18%，同期业绩比较基准收益率为 2.70%。

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 2026 年下半年，国际环境和地缘政治博弈难以缓和，中东的复杂局势对全球能源和供应链的稳定构成较大扰动，全球通胀压力可能反复，美联储可能维持较高利率水平，高利率环境对全球资本流动和风险偏好形成压制，全球贸易摩擦与科技竞争持续深化。国内方面，经济复苏动能仍偏弱，内需修复缓慢，房地产投资持续低迷，居民消费信心不足，企业投资意愿分化，传统制造业扩张谨慎，新兴产业投资保持韧性。政策层面，财政政策有望延续积极基调，基建投资托底作用增强。货币政策维持宽松基调，但受制于汇率压力与银行净息差约束，宽松节奏可能更加审慎，若出现经济增长有失速风险可能出现使得央行进一步宽松。

2026 年下半年债券市场可能以区间震荡为主，难现单边趋势行情。货币政策维持适度宽松，以短期工具熨平资金波动，降准降息操作偏审慎，经济内需偏弱、物价温和修复，构成利率下行支撑，但三季度政府债集中放量形成供给压制，长端空间受限。海外美联储维持高利率、美债高位震荡，中美利差倒挂持续约束长久期做多。信用债延续分层，高等级配置价值稳定，弱区域、地产链品种风险仍存。我们维持组合债券仓位和久期在较低水平，预留部分流动性空间，主要配置利率债，总体以获取较高安全度的票息收益为主，对于信用资质下沉策略非常谨慎。

2026 年下半年 A 股有望维持偏震荡的结构性行情，国内货币维持均衡宽松，总量刺激有限，产业政策持续倾斜 AI 产业和高端制造，经济温和弱修复，外需与科创投资托底，地产、消费修复缓慢压制整体估值中枢，难现全面普涨。流动性层面，美联储高利率持续扰动美债与北向资金，中报季高估值科技股将迎来业绩检验，拥挤赛道波动放大。主线仍可能聚焦在半导体、算力和出海等高景气硬科技，市场由上半年估值炒作转向业绩验证驱动，分化程度边际收敛但成长仍会占优，业绩兑现能力将成为板块分化的核心标尺，业绩超预期的公司有望获得估值溢价，而业绩不及预期或缺乏明确增长路径的标的则面临估值回调压力。我们会深入研究上市公司各板块盈利兑现情况，坚持沿着业绩寻找主线，紧跟产业逻辑和公司业绩，重点关注业绩确定性强、估值合理的科技成长与资源周期龙头，坚持筛选基本面扎实、长期逻辑不断验证且估值性价比较高的投资标的进行积极布局。

2026 年下半年转债维持结构性震荡，存量持续收缩、固收+配置需求托底整体估值高位运行。权益端科技成长仍是弹性主线，算力、半导体转债行情占优，但赛道拥挤、中报业绩验证带来波动，高价券强赎踩踏风险持续存在，低价债性券阶段性提供防御。信用分层加剧，高评级标的更安全，

弱资质小盘、地产链转债承压。我们坚持“正股为锚、条款为盾、估值为尺”的三维筛选框架，在严守信用底线前提下，我们将综合市场流动性环境、正股波动率和债券收益率情况，精选低溢价、正股业绩能见度高且行业景气向上的优质个券，适度拉长久期以捕捉正股上行弹性，同时强化转债条款博弈能力，在估值高位环境下注重安全边际与下修预期兑现节奏。

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，负责对各类投资品种的估值方法、估值模型等进行研究和论证，组织制定和适时修订估值政策和程序。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。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

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

本基金本报告期未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在新华锦利债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的

规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

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、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：新华锦利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	4,029,002.93
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	42,365,646.25
其中：股票投资		4,046,324.60
基金投资		-
债券投资		38,319,321.65
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	5,400,000.00
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		11,954.68
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		51,806,603.86
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		-
应付清算款		-
应付赎回款		1,167,313.59
应付管理人报酬		30,525.50
应付托管费		7,631.39
应付销售服务费		3,176.63
应付投资顾问费		-
应交税费		1,225.25
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	57,236.58
负债合计		1,267,108.94
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	49,444,113.19
其他综合收益		-
未分配利润	6.4.7.8	1,095,381.73
净资产合计		50,539,494.92
负债和净资产总计		51,806,603.86

注：1、报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 49,444,113.19 份。其中：A 类基金份额净值 1.0223 元，基金份额 33,739,892.48 份；C 类基金份额净值 1.0218 元，基金份额 15,704,220.71 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2026 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日。

6.2 利润表

会计主体：新华锦利债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 3 月 27 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 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		1,994,063.10
1.利息收入	6.4.7.9	186,412.05
其中：存款利息收入		53,252.90
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		133,159.15
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,102,864.76
其中：股票投资收益	6.4.7.10	805,894.38
基金投资收益	6.4.7.11	-
债券投资收益	6.4.7.12	286,732.73
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	10,237.65
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	704,037.53
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	748.76
减：二、营业总支出		371,993.55
1. 管理人报酬		229,538.73
其中：暂估管理人报酬（若有）		-
2. 托管费		57,384.64
3. 销售服务费		33,037.29
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	6.4.7.19	-
7. 税金及附加		356.29
8. 其他费用	6.4.7.20	51,676.60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,622,069.55
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,622,069.55
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		1,622,069.55

注：本基金合同生效日为 2026 年 3 月 27 日，无上年度同期对比数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：新华锦利债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 3 月 27 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 3 月 27 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（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
二、本期期初净资产	269,591,226.28	-	-	269,591,226.28
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-220,147,113.09	-	1,095,381.73	-219,051,731.36
（一）、综合收益总额	-	-	1,622,069.55	1,622,069.55
（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）	-220,147,113.09	-	-526,687.82	-220,673,800.91
其中：1.基金申购款	7,797,744.56	-	109,481.10	7,907,225.66
2.基金赎回款	-227,944,857.65	-	-636,168.92	-228,581,026.57
（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、本期期末净资产	49,444,113.19	-	1,095,381.73	50,539,494.92

注：本基金合同生效日为 2026 年 3 月 27 日，无上年度同期对比数据。

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：

基金管理人负责人：银国宏，主管会计工作负责人：王宇成，会计机构负责人：涂运华

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

新华锦利债券型证券投资基金(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[2025]2669 号文的核准,由新华基金管理股份有限公司向社会公开募集,基金合同于 2026 年 3 月 27 日正式生效,首次设立募集规模为 269,591,226.28 份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限为不定期。本基金的基金管理人为新华基金管理股份有限公司,基金托管人

为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表按照财政部颁布的《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”）、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《证券投资基金会计核算业务指引》、《新华锦利债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2026 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 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 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 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或金融负债。

（1）金融资产

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。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的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股票投资、债券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。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

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在初始确认时以公允价值计量。对于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，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和金融负债，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，本基金对于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。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

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、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

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。由于申购和赎回引起的实收基金份额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基金净值比例计算的金额。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基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认，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和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

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

本基金各基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可供分配利润可能有所不同，同一类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所有者权益转出。

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

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个

人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《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》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《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》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、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》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，暂适用简易计税方法，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、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。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。

自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

（2）对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（3）对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

（4）基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

6.4.7重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	3,981,885.85
等于：本金	3,980,672.72
加：应计利息	1,213.13
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	47,117.08
等于：本金	47,084.43
加：应计利息	32.65
合计	4,029,002.93

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

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		3,340,077.43	-	4,046,324.60	706,247.17
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	28,023,159.64	253,146.31	28,270,746.31	-5,559.64
	银行间市场	10,002,650.00	42,575.34	10,048,575.34	3,350.00
	合计	38,025,809.64	295,721.65	38,319,321.65	-2,209.64
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-

合计	41,365,887.07	295,721.65	42,365,646.25	704,037.53
----	---------------	------------	---------------	------------

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	5,400,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	5,400,000.00	-

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从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	5,960.10
其中：交易所市场	-
银行间市场	5,960.10
应付利息	-
应付证券时报	31,561.92
应付账户维护费	6,000.00
应付审计费	13,714.56
合计	57,236.58

6.4.7.7 实收基金

新华锦利债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026年3月27日（基金合同生效日）至2026年6月30日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	137,133,382.31	137,133,382.31
本期申购	6,171,109.77	6,171,109.77
本期赎回（以“-”号填列）	-109,564,599.60	-109,564,599.60
本期末	33,739,892.48	33,739,892.48

新华锦利债券 C

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026年3月27日（基金合同生效日）至2026年6月30日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	132,457,843.97	132,457,843.97
本期申购	1,626,634.79	1,626,634.79
本期赎回（以“-”号填列）	-118,380,258.05	-118,380,258.05
本期末	15,704,220.71	15,704,220.71

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

新华锦利债券 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	614,518.04	491,409.94	1,105,927.98
本期基金份额交易产生的变动数	-187,591.53	-165,685.08	-353,276.61
其中：基金申购款	48,535.21	36,451.39	84,986.60
基金赎回款	-236,126.74	-202,136.47	-438,263.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	426,926.51	325,724.86	752,651.37

新华锦利债券 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	303,513.98	212,627.59	516,141.57
本期基金份额交易产生的变动数	-112,337.06	-61,074.15	-173,411.21
其中：基金申购款	10,738.33	13,756.17	24,494.50
基金赎回款	-123,075.39	-74,830.32	-197,905.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	191,176.92	151,553.44	342,730.36

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	51,918.16
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,334.74
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	53,252.90

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金的利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	13,943,601.04
减：卖出股票成本总额	13,115,404.58
减：交易费用	22,302.08
买卖股票差价收入	805,894.38

6.4.7.11 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.12 债券投资收益**6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2026年3月27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	314,066.97
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-27,334.24
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	286,732.73

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年3月27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	420,769,559.42
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	414,885,205.24
减：应计利息总额	5,909,413.42
减：交易费用	2,275.00
买卖债券差价收入	-27,334.24

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年3月27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	10,237.65
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	10,237.65

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年3月27日（基金合同生效日）至2026年6月30日
1.交易性金融资产	704,037.53
——股票投资	706,247.17
——债券投资	-2,209.64
——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	704,037.53

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年3月27日（基金合同生效日）至2026年6月30日
基金赎回费收入	748.76
合计	748.76

6.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年3月27日（基金合同生效日）至2026年6月30日
审计费用	13,714.56
信息披露费	31,561.92

证券出借违约金	-
存托服务费	0.12
账户维护费	6,000.00
开户费	400.00
合计	51,676.60

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内本基金不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
新华基金管理股份有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国邮政储蓄银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
金融街证券股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构

注：1、自 2025 年 9 月 9 日起，公司控股股东恒泰证券股份有限公司更名为金融街证券股份有限公司。

2、以下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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2026年3月27日（基金合同生效日）至2026年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
金融街证券股份有	30,399,083.05	100.00%

限公司		
-----	--	--

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2026年3月27日（基金合同生效日）至2026年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
金融街证券股份有限 公司	330,203,880.88	100.00%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2026年3月27日（基金合同生效日）至2026年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
金融街证券股份有限 公司	285,400,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期			
	2026年3月27日（基金合同生效日）至2026年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
金融街证券股份有限 公司	13,382.88	100.00%	-	-

注：1、上述佣金按合同约定的佣金率计算。

2、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，针对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，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；针对其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但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，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

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3月27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	229,538.73
其中：应支付销售机构的客户维护费	108,761.18
应支付基金管理人的净管理费	120,777.55

注：1、基金管理费按前一日基金资产净值 0.6%的年费率计提,每日计提，按月支付。

其计算公式为:每日应计提的基金管理费=前一日基金资产净值×0.6%/当年天数；

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定的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，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年3月27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	57,384.64

注：基金托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，每日计提，按月支付。

其计算公式为:每日应计提的基金托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026年3月27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		
	新华锦利债券 A	新华锦利债券 C	合计
中国邮政储蓄银行股份有限公司	-	18,328.96	18,328.96
合计	-	18,328.96	18,328.96

注：基金销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.20%年费率计提，每日计提，按月支付。

其计算公式为：每日应计提的基金销售服务费=前一日 C 类基金资产净值×0.20%/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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末未发生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。

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

本基金本报告期末未发生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。

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

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

本基金本报告期除基金管理人之外的其他关联方未有投资本基金的情况。

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3月27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
中国邮政储蓄银行股份有限公司	3,981,885.85	51,918.16

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期在承销期内未参与关联方承销证券。

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。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券产生的流通受限证券。

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从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

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**

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以董事会下设的审计委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的风险管理架构体系。

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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人通过严格的投资备选库制度、交易对手库管理和分散化投资方式防范信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年6月30日
--------	-------------------

A-1	-
A-1 以下	-
未评级	38,319,321.65
合计	38,319,321.65

- 注：1.本基金于 2026 年 3 月 27 日成立，无上年度末可比数据。
- 2.债券评级取自第三方评级机构的债项评级。
- 3.未评级债券为国债、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

- 1.本期末，本基金未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。
- 2.本基金于 2026 年 3 月 27 日成立，无上年度末可比数据。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

- 1.本期末，本基金未持有按短期信用评级列示的同业存单。
- 2.本基金于 2026 年 3 月 27 日成立，无上年度末可比数据。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

- 1.本期末，本基金未持有按长期信用评级列示的债券。
- 2.本基金于 2026 年 3 月 27 日成立，无上年度末可比数据。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

- 1.本期末，本基金未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。
- 2.本基金于 2026 年 3 月 27 日成立，无上年度末可比数据。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

- 1.本期末，本基金未持有按长期信用评级列示的同业存单。
- 2.本基金于 2026 年 3 月 27 日成立，无上年度末可比数据。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险。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。

除卖出回购金融资产款余额（计息但该利息金额不重大）以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，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按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《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组合的流动性指标进行持续的监测和分析。本报告期内，本基金资产的投资比例符合基金流动性风险管理的相关规定，流动性风险较低。

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现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	4,029,002.93	-	-	-	4,029,002.93
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	38,319,321.65	-	-	4,046,324.60	42,365,646.25
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	5,400,000.00	-	-	-	5,400,000.00
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-

应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	11,954.68	11,954.68
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	47,748,324.58	-	-	4,058,279.28	51,806,603.86
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	1,167,313.59	1,167,313.59
应付管理人报酬	-	-	-	30,525.50	30,525.50
应付托管费	-	-	-	7,631.39	7,631.39
应付销售服务费	-	-	-	3,176.63	3,176.63
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	1,225.25	1,225.25
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	57,236.58	57,236.58
负债总计	-	-	-	1,267,108.94	1,267,108.94
利率敏感度缺口	47,748,324.58	-	-	2,791,170.34	50,539,494.92

注：1.本基金于 2026 年 3 月 27 日成立，无上年度末可比数据。

2.表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同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	其他市场变量不变，市场利率上升或下降 25 个基点。		
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	
	市场利率上升 25.00 bp	-39,746.86	
	市场利率下降 25.00 bp	39,855.30	

注：本基金于 2026 年 3 月 27 日成立，无上年度末可比数据。

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。

本期末，本基金的所有资产与负债均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

在其他价格风险分析中，本基金管理人主要分析市场价格风险的影响。市场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，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

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	4,046,324.60	8.01
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	38,319,321.65	75.82
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
合计	42,365,646.25	83.83

注：本基金于 2026 年 3 月 27 日成立，无上年度末可比数据。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩基准以外的其他市场变量保持不变。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2026 年 6 月 30 日

	业绩比较基准上升 5%	1,614,131.12
	业绩比较基准下降 5%	-1,614,131.12

注：本基金于 2026 年 3 月 27 日成立，无上年度末可比数据。

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	4,046,324.60
第二层次	38,319,321.65
第三层次	-
合计	42,365,646.25

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，确定相关股票和债券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

本基金本报告期末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	4,046,324.60	7.81
	其中：股票	4,046,324.60	7.81
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	38,319,321.65	73.97
	其中：债券	38,319,321.65	73.97
	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	5,400,000.00	10.42
	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	4,029,002.93	7.78
8	其他各项资产	11,954.68	0.02
9	合计	51,806,603.86	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

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	76,432.00	0.15
B	采矿业	65,920.00	0.13
C	制造业	3,743,294.60	7.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-

F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	160,678.00	0.32
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,046,324.60	8.01

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300604	长川科技	600	204,852.00	0.41
2	002384	东山精密	700	183,645.00	0.36
3	301308	江波龙	200	140,760.00	0.28
4	688017	绿的谐波	300	125,358.00	0.25
5	300757	罗博特科	200	123,800.00	0.24
6	002463	沪电股份	800	122,240.00	0.24
7	688525	佰维存储	200	98,946.00	0.20
8	300567	精测电子	300	95,280.00	0.19
9	001389	广合科技	400	94,900.00	0.19
10	688629	华丰科技	500	93,755.00	0.19
11	605358	立昂微	1,100	85,360.00	0.17
12	300502	新易盛	140	84,980.00	0.17
13	688166	博瑞医药	2,400	84,024.00	0.17
14	300136	信维通信	700	83,475.00	0.17

15	002558	巨人网络	3,000	82,680.00	0.16
16	688469	芯联集成	7,700	81,697.00	0.16
17	688266	泽璟制药	700	81,662.00	0.16
18	603986	兆易创新	100	81,500.00	0.16
19	688322	奥比中光	600	78,330.00	0.15
20	600316	洪都航空	2,800	78,232.00	0.15
21	688702	盛科通信	200	77,998.00	0.15
22	688002	睿创微纳	500	77,345.00	0.15
23	688114	华大智造	1,500	76,620.00	0.15
24	002157	正邦科技	27,200	76,432.00	0.15
25	002436	兴森科技	1,500	76,425.00	0.15
26	000519	中兵红箭	3,600	75,852.00	0.15
27	300223	北京君正	300	74,670.00	0.15
28	002414	高德红外	5,600	74,256.00	0.15
29	603077	和邦生物	31,700	73,544.00	0.15
30	301200	大族数控	200	72,130.00	0.14
31	300073	当升科技	1,500	72,060.00	0.14
32	600392	盛和资源	2,400	71,448.00	0.14
33	002738	中矿资源	1,200	70,788.00	0.14
34	600183	生益科技	400	69,360.00	0.14
35	300476	胜宏科技	200	69,286.00	0.14
36	300432	富临精工	3,400	68,306.00	0.14
37	301358	湖南裕能	900	68,283.00	0.14
38	300857	协创数据	200	67,980.00	0.13
39	002466	天齐锂业	1,100	67,452.00	0.13
40	000657	中钨高新	700	67,004.00	0.13
41	300395	菲利华	500	66,865.00	0.13
42	300394	天孚通信	220	66,589.60	0.13
43	688183	生益电子	500	66,200.00	0.13
44	000426	兴业银锡	2,000	65,920.00	0.13
45	300390	天华新能	700	65,457.00	0.13
46	002460	赣锋锂业	1,000	65,400.00	0.13
47	002281	光迅科技	200	51,388.00	0.10
48	002916	深南电路	100	45,790.00	0.09

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	688002	睿创微纳	302,100.00	0.60

2	000426	兴业银锡	277,612.00	0.55
3	002916	深南电路	276,395.00	0.55
4	688266	泽璟制药	271,403.74	0.54
5	300432	富临精工	269,074.00	0.53
6	301358	湖南裕能	267,315.00	0.53
7	000657	中钨高新	266,586.00	0.53
8	002558	巨人网络	264,924.00	0.52
9	001389	广合科技	260,242.00	0.51
10	301200	大族数控	259,494.00	0.51
11	002463	沪电股份	257,416.00	0.51
12	300857	协创数据	252,280.00	0.50
13	688629	华丰科技	250,676.00	0.50
14	600183	生益科技	247,574.00	0.49
15	300390	天华新能	243,684.00	0.48
16	002738	中矿资源	241,258.00	0.48
17	688183	生益电子	228,262.27	0.45
18	002384	东山精密	223,155.00	0.44
19	300394	天孚通信	221,814.00	0.44
20	688469	芯联集成	220,246.43	0.44

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以数量）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	600183	生益科技	297,042.00	0.59
2	002916	深南电路	285,725.00	0.57
3	000657	中钨高新	283,623.00	0.56
4	301200	大族数控	278,959.00	0.55
5	688002	睿创微纳	244,873.06	0.48
6	300857	协创数据	226,021.00	0.45
7	000893	亚钾国际	210,889.00	0.42
8	300567	精测电子	210,420.00	0.42
9	605117	德业股份	209,022.80	0.41
10	688469	芯联集成	207,769.00	0.41
11	001389	广合科技	204,419.00	0.40
12	688629	华丰科技	204,055.00	0.40
13	688266	泽璟制药	200,081.34	0.40
14	002463	沪电股份	199,460.00	0.39
15	300037	新宙邦	195,988.00	0.39
16	000426	兴业银锡	188,759.00	0.37

17	301358	湖南裕能	188,268.00	0.37
18	300394	天孚通信	186,248.00	0.37
19	300390	天华新能	185,662.00	0.37
20	688183	生益电子	182,425.00	0.36

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以数量）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

买入股票的成本（成交）总额	16,455,482.01
卖出股票的收入（成交）总额	13,943,601.04

注：“买入股票的成本（成交）总额”与“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以数量）填列，不考虑相关费用。

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	28,270,746.31	55.94
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,048,575.34	19.88
	其中：政策性金融债	10,048,575.34	19.88
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	38,319,321.65	75.82

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	占基金资产净
----	------	------	-------	------	--------

					值比例(%)
1	019792	25 国债 19	100,000	10,104,923.29	19.99
2	019827	26 国债 01	100,000	10,064,819.18	19.91
3	260411	26 农发 11	100,000	10,048,575.34	19.88
4	019785	25 国债 13	80,000	8,101,003.84	16.03

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业发展银行在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 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

本报告期末，本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

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	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	11,954.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,954.68

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，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	持有份额	占总份

				额比例		额比例
新华锦利债券 A	1,246	27,078.57	0.00	0.00%	33,739,892.48	100.00 %
新华锦利债券 C	277	56,693.94	0.00	0.00%	15,704,220.71	100.00 %
合计	1,523	32,464.95	0.00	0.00%	49,444,113.19	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	新华锦利债券 A	199.78	0.00%
	新华锦利债券 C	1,000.34	0.01%
	合计	1,200.12	0.00%

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的情况

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	新华锦利债券 A	0
	新华锦利债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	新华锦利债券 A	0
	新华锦利债券 C	0
	合计	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	新华锦利债券 A	新华锦利债券 C
基金合同生效日（2026 年 3 月 27 日）基金份额总额	137,133,382.31	132,457,843.97
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	6,171,109.77	1,626,634.79
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	109,564,599.60	118,380,258.05
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	33,739,892.48	15,704,220.71

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

基金管理人于 2026 年 2 月 25 日发布公告，自 2026 年 2 月 24 日起张鹏先生担任公司副总经理兼财务负责人，徐端骞先生离任公司副总经理兼首席信息官。基金管理人于 2026 年 4 月 21 日发布公告，自 2026 年 4 月 20 日起王宇成先生担任公司副总经理兼首席信息官。上述事项经基金管理人董事会审议通过，并按照现行法律法规履行备案程序。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期末未有涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未发生改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期本基金未持有基金。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未有改聘会计师事务所的情况。

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

本报告期内，本基金管理人无受到调查或处罚等情况。

10.7.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受到调查或处罚等情况。

10.7.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人托管业务部门未受到调查或处罚。

10.7.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚。

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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	----	------	-----------	----

	单元 数量	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	
金融街证券	3	30,399,083.05	100.00%	13,382.88	100.00%	-

注：一、交易单元的选择标准：

（一）基本情况：财务状况良好，财务指标符合证券公司监管要求；

（二）合规风控：公司治理完善，内部管理规范，内控制度健全；

（三）研究服务实力方面需满足以下条件：1、有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务；2、能根据公司所管理基金的特定要求，提供专题研究报告；3、具备较强的服务意识，能主动为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

（四）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要。

二、交易单元的选择程序：

（一）公司研究部根据上述标准考察后确定合作的证券公司名单。

（二）公司与被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

三、本基金管理人已根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（证监会公告[2024]3号）及证券业协会测算结果完成佣金调整工作。本部分数据统计时间区间与本报告的报告期一致，统计范围仅包括本基金。

10.8.2 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		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
金融街证券	330,203,880.88	100.00%	285,400,000.00	100.00%	-	-

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	新华锦利债券型证券投资基金基金合同及招	证券时报、管理人网站、	2026-02-26

	募说明书提示性公告	中国证监会基金电子披露网站	
2	新华锦利债券型证券投资基金基金合同	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-02-26
3	新华锦利债券型证券投资基金托管协议	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-02-26
4	新华锦利债券型证券投资基金招募说明书	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-02-26
5	新华锦利债券型证券投资基金基金产品资料概要	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-02-26
6	新华锦利债券型证券投资基金基金份额发售公告	证券时报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-02-26
7	新华锦利债券型证券投资基金基金合同生效公告	证券时报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-28
8	新华基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-21
9	新华锦利债券型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务公告	证券时报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-24
10	新华基金管理股份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相关销售业务及后续投资者服务措施的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-06-01

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内本基金未有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

- （一）中国证监会准予新华锦利债券型证券投资基金注册的文件
- （二）《关于申请募集新华锦利债券型证券投资基金之法律意见书》

- (三) 《新华锦利债券型证券投资基金托管协议》
- (四) 《新华锦利债券型证券投资基金基金合同》
- (五) 《新华锦利债券型证券投资基金招募说明书》
- (六) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (七) 基金托管人业务资格批件、营业执照

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

12.3 查阅方式

投资者可在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查阅。

新华基金管理股份有限公司

二〇二六年八月二十八日