

华夏睿磐泰利混合型证券投资基金
2026 年中期报告
2026 年 6 月 30 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

送出日期：二〇二六年八月三十一日

§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。

基金托管人中国光大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 1 月 1 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
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
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	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	15
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
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	57
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	58
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	58
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	58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
7.12 本报告期投资基金情况	58
7.13 投资组合报告附注	58

§8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
8.2 盈利投资者数量占比	59
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	60
§9 开放式基金份额变动	60
§10 重大事件揭示	61
10.1 基金份额持有人大会决议	61
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	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
10.4 基金投资策略的改变	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	61
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	61
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	61
10.8 其他重大事件	63
§11 影响投资者决策的其他重要信息	64
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	64
§12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录	64
12.2 存放地点	64
12.3 查阅方式	65

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏睿磐泰利混合型证券投资基金	
基金简称	华夏睿磐泰利混合	
基金主代码	005177	
交易代码	005177	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 12 月 27 日	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	792,934,416.65 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华夏睿磐泰利混合 A	华夏睿磐泰利混合 C
下属分级基金的交易代码	005177	005178
报告期末下属分级基金的份额总额	344,474,435.86 份	448,459,980.79 份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过风险均衡方法进行资产配置，积极管理，力求有效控制风险，实现基金资产长期持续增值。
投资策略	主要投资策略包括资产配置策略、股票投资策略、固定收益品种投资策略、资产支持证券投资策略、权证投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略等。在资产配置策略上，本基金以风险均衡作为主要资产配置策略，通过平衡各资产类别对整个组合风险贡献，合理确定本基金在股票、债券等资产上的投资比例。在股票投资策略上，本基金股票投资策略分为主动量化股票投资策略和基于风险均衡的股票投资策略。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×20%+上证国债指数收益率×80%。
风险收益特征	本基金为混合基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金，高于债券基金、货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华夏基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	王茵
	联系电话	400-818-6666	010-63639180

	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	wangyin@cebbank.com
客户服务电话		400-818-6666	95595
传真		010-63136700	010-63639132
注册地址		北京市顺义区安庆大街甲3号院	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
办公地址		北京市朝阳区北辰西路6号院北辰中心C座5层	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码		100101	100033
法定代表人		邹迎光	吴利军

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	www.ChinaAMC.com
基金中期报告置备地点	基金管理人和/或基金托管人的住所/办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华夏基金管理有限公司	北京市朝阳区北辰西路6号院北辰中心C座5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1月1日-2026年6月30日）	
	华夏睿磐泰利混合 A	华夏睿磐泰利混合 C
本期已实现收益	11,753,956.16	12,232,856.56
本期利润	16,705,282.57	17,059,642.56
加权平均基金份额本期利润	0.0526	0.0419
本期加权平均净值利润率	3.51%	2.86%
本期基金份额净值增长率	3.64%	3.48%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026年6月30日）	
	华夏睿磐泰利混合 A	华夏睿磐泰利混合 C
期末可供分配利润	152,943,848.77	183,522,480.53

期末可供分配基金份额利润	0.4440	0.4092
期末基金资产净值	523,897,306.17	666,243,992.11
期末基金份额净值	1.5209	1.4856
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026年6月30日）	
	华夏睿磐泰利混合 A	华夏睿磐泰利混合 C
基金份额累计净值增长率	58.81%	55.37%

注：①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②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。

③期末可供分配利润为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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华夏睿磐泰利混合 A：

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	2.97%	0.23%	3.51%	0.27%	-0.54%	-0.04%
过去六个月	3.64%	0.22%	3.61%	0.25%	0.03%	-0.03%
过去一年	7.22%	0.20%	7.17%	0.22%	0.05%	-0.02%
过去三年	15.26%	0.18%	17.75%	0.23%	-2.49%	-0.05%
过去五年	20.07%	0.18%	19.79%	0.22%	0.28%	-0.04%
过去七年	54.96%	0.20%	36.32%	0.23%	18.64%	-0.03%
自基金转型起至今	58.81%	0.20%	38.48%	0.24%	20.33%	-0.04%

华夏睿磐泰利混合 C：

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	2.90%	0.23%	3.51%	0.27%	-0.61%	-0.04%
过去六个月	3.48%	0.22%	3.61%	0.25%	-0.13%	-0.03%
过去一年	6.89%	0.20%	7.17%	0.22%	-0.28%	-0.02%
过去三年	14.24%	0.18%	17.75%	0.23%	-3.51%	-0.05%

过去五年	18.31%	0.18%	19.79%	0.22%	-1.48%	-0.04%
过去七年	51.76%	0.20%	36.32%	0.23%	15.44%	-0.03%
自基金转型起至今	55.37%	0.20%	38.48%	0.24%	16.89%	-0.04%

3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏睿磐泰利混合型证券投资基金

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

(2019 年 2 月 27 日至 2026 年 6 月 30 日)

华夏睿磐泰利混合 A:



华夏睿磐泰利混合 C:



注：本基金自 2019 年 2 月 27 日起由“华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金”转型而来。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州、青岛、武汉及沈阳设有分公司，在香港、深圳、上海、北京设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、首批个人养老金基金管理人、境内首批中日互通 ETF 基金管理人、首批商品期货 ETF 基金管理人、首批纳入互联互通 ETF 基金管理人、首批北交所主题基金管理人以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人、公募 REITs 管理人、首批浮动管理费基金管理人、首批公募 REITs 指数基金管理人，境内首家承诺“碳中和”具体目标和路径的公募基金公司，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

华夏基金是境内 ETF 基金资产管理规模最大的基金管理公司之一，在 ETF 基金管理方面积累了丰富的经验，形成了覆盖宽基指数、港股（QDII）指数、港股（港股通）指数、行业主题指数、策略指数、跨境指数、固收指数、商品指数等较为完整的产品线。

华夏基金以深入的投资研究为基础，尽力捕捉市场机会，为投资人谋求良好的回报。根据银河证券基金研究中心《中国基金业绩评价报告》，截至 2026 年 6 月 30 日，华夏基金旗下多只产品近 1 年同类排名靠前（基金排名不作为产品未来表现的保证）：

主动权益产品：在混合型 FOF(权益资产 30%-60%)(A 类)中，华夏聚源优选三个月持有混合（FOF）(A 类)排名第 1/25；在低碳环保行业股票型基金(A 类)中，华夏节能环保股票(A 类)排名第 1/10；在 TMT 与信息技术行业偏股型基金(A 类)中，华夏数字产业混合(A 类)排名第 2/64；在低碳环保偏股型基金(A 类)中，华夏低碳经济一年持有混合(A 类)排名第 3/32；在债券型 FOF(A 类)中，华夏聚顺优选六个月持有债券（FOF）(A 类)排名第 3/24；在养老目标日期 FOF(2045)(A 类)中，华夏养老 2045 三年持有混合（FOF）(A 类)排名第 3/18；在养老目标日期 FOF(2050)(A 类)中，华夏养老 2050 五年持有混合（FOF）(A 类)排名第 3/15；在 QDII 混合基金(A 类)中，华夏移动互联混合（QDII）排名第 3/56、华夏新时代混合（QDII）排名第 5/56、华夏全球科技先锋混合（QDII）排名第 7/56；在偏股型基金(股票上限 80%)(A 类)中，华夏成长混合排名第 13/149；在医药医疗健康行业偏股型基金(A 类)中，华夏乐享健康混合(A 类)排名第 15/89；在偏股型基金(股票上限 95%)(A 类)中，华夏线上经济主题精选混合排名第 25/220；在标准股票型基金(A 类)中，华夏创新前沿股票(A 类)排名第 43/354、华夏领先股票排名第 49/354、华夏经济转型股票排名第 57/354、华夏潜龙精选股票排名第 66/354；在灵活配置型基金(基准股票比例 30%-60%)(A 类)中，华夏磐晟混合（LOF）排名第 35/397、华夏新锦程混合(A 类)排名第 62/397、华夏稳增混合排名第 79/397；在灵活配置型基金(基准股票比例 60%-100%)(A 类)中，华夏高端制造混合(A 类)排名第 36/478；在偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 类)中，华夏先进制造龙头混合(A 类)排名第 23/1941、华夏科技创新混合(A 类)排名第 78/1941、华夏成长先锋一年持有混合(A 类)排名第 116/1941、华夏核心科技 6 个月定开混合(A 类)排名第 191/1941、华夏产业升级混合(A 类)排名第 212/1941、华夏国企创新混合发起式（A 类）排名第 249/1941、华夏成长机会一年持有混合排名第 268/1941、华夏创业板两年定开混合排名第 276/1941、华夏盛世混合排名第 292/1941、华夏创新驱动混合(A 类)排名第 365/1941、华夏科技前沿 6 个月定开混合(A 类)排名第 372/1941、华夏行业景气混合(A 类)排名第 374/1941。

固收与固收+产品：在可转换债券型基金(A 类)中，华夏可转债增强债券 A 排名第 1/38；在普通债券型基金(可投转债)(A 类)中，华夏双债债券 A 排名第 1/280、华夏聚利债券 A 排名第 4/280、华夏债券 AB 排名第 74/280；在普通偏债型基金(股票上限不高于 30%)(A 类)中，华夏永康添福混合 A

排名第 2/307、华夏兴源稳健一年持有混合 A 排名第 17/307、华夏永顺一年持有混合 A 排名第 31/307；在短期纯债债券型基金(A 类)中，华夏安益短债债券 A 排名第 7/133、华夏 30 天滚动短债债券发起式 A 排名第 8/133；在利率债纯债债券型基金(A 类)中，华夏鼎昭利率债债券 A 排名第 7/98；在普通债券型基金(二级)(A 类)中，华夏鼎沛债券 A 排名第 10/540、华夏鼎清债券 A 排名第 12/540、华夏鼎利债券 A 排名第 47/540；在普通偏债型基金(股票上限高于 30%)(A 类)中，华夏永鑫六个月持有混合 A 排名第 17/245、华夏永泓一年持有混合 A 排名第 28/245；在长期纯债债券型基金(A 类)中，华夏鼎富债券 A 排名第 61/1041、华夏鼎航债券 A 排名第 67/1041、华夏鼎信债券 A 排名第 115/1041、华夏纯债债券 A 排名第 234/1041、华夏鼎茂债券 A 排名第 268/1041；在标准偏债型基金(股票上下限 10%-30%)(A 类)中，华夏稳进增益一年持有混合 A 排名第 11/71。

在客户服务方面，2026 年上半年，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户使用的便利性和服务体验：（1）华夏基金管家客户端优化基金详情展示，增强信息可读性，从客户投资需求出发，进一步提升使用体验；（2）与国贸期货、新华信通等代销机构合作，拓展更加丰富的客户理财渠道；（3）开展“未来，我们继续一起走过”、“选择难度大？给你支个招”、“当前科技股的三国博弈”等活动，为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

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		
靖博灵	本基金的基金经理	2025-10-23	-	10 年	硕士。2016 年 7 月加入华夏基金管理有限公司。历任数量投资部研究员、基金经理助理。
郝彬	本基金的基金经理	2025-10-23	-	9 年	硕士。2017 年 7 月加入华夏基金管理有限公司。历任研究员、投资经理助理、投资经理。
孙蕾	本基金的基金经理助理	2025-12-17	-	11 年	硕士。2015 年 5 月加入华夏基金管理有限公司。历任固定收益

					部研究员、基金经理助理。
--	--	--	--	--	--------------

注：①上述“任职日期”和“离任日期”为根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。首任基金经理的，其“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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 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《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》等法律法规和基金合同，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，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《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 45 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要发生的反向交易。

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

2026 年上半年，国内宏观经济整体呈“先扬后抑”的结构性分化格局。一季度经济起步有力，运行态势向好，二季度虽受多重因素影响增速有所回落，但新旧动能转换的节奏持续加快。整体来看，居民消费修复步伐仍偏缓慢，内需修复呈现不均衡特征，服务类消费虽保持较快增长，但整体消费信心完全恢复仍需时间。房地产市场仍处于磨底阶段，开发投资延续下行趋势，调整压力最大的阶段虽已过去，但全面企稳的明确信号尚未出现。与此同时，高技术制造业持续处于扩张区间，人工智能产业、高端制造等新动能加速发展，景气度长期维持高位，继续充当产业升级与工业增长

的核心引擎。国际方面，海外供应链重塑的大背景下，国内制造业出口的替代优势持续凸显，高技术、高附加值产品出口占比稳步提升，外资对 A 股核心资产的配置意愿也在逐步修复。

权益市场维度，2026 年上半年在宏观弱复苏与流动性合理充裕的博弈中，演绎出极致的结构性分化行情。市场风格在震荡中完成显著切换，资金从防御性板块大举撤出，转而集中进攻具备产业逻辑硬支撑的成长方向。高端制造与先进制造板块成为贯穿始终的绝对主线，受益于全球供应链重塑及国内“新质生产力”政策的双重驱动，半导体设备、通信、人形机器人等人工智能上下游细分赛道景气度持续飙升，推动板块估值与业绩共同增长，牢牢确立了全市场领涨地位。与之形成鲜明对比的是，此前长期拥挤的红利资产遭遇资金抛弃，高股息策略的相对吸引力明显下降，资金持续流出导致高股息策略阶段性承压，市场整体从持续多时的“避险模式”全面切换至聚焦产业趋势的“逐利模式”。

债券市场方面，2026 年上半年整体走出超预期偏强震荡的慢牛行情，主要呈现“短端下行明显、长端震荡走低、信用利差压缩、曲线阶段性陡峭化”的特征。在流动性持续宽松、基本面温和走弱及“资产荒”逻辑的支撑下，债市整体收益率下行，但年中受资金面边际收敛及机构止盈影响，债市出现阶段性调整。上半年看，利率债整体下行明显，长端（10 年、30 年）表现收益优于短端，收益率曲线陡峭化。10 年期国债收益率整体在 1.7%-1.9% 区间运行，部分时段创年内新低。信用债上看，收益率整体下行，“资产荒”格局延续其中高等级信用债利差持续压缩，部分短端利差创历史新低，二永债得益于良好的供需格局表现较强。分阶段看，1—2 月为高位震荡阶段，年初基本面延续高景气度，政府债供给预期+权益走强压制，长端偏弱，资金宽松支撑短端，曲线略熊陡后转平。3-5 月为慢牛阶段，基本面走弱叠加资金利率低位下非银资金入场，长端接力下行，10Y 国债逼近 1.70%。6 月为高位震荡阶段，资金边际收敛下收益率冲高后回吐，多空博弈加剧，10Y 国债在 1.70% 关口附近拉锯。

本基金始终秉持稳健的投资目标与清晰的投资风格，持续迭代优化投资框架与细分策略，致力于构建具备可预期收益风险特征的长期投资组合。报告期内，我们以客观、系统化的视角动态评估各类资产的相对性价比，全面践行多资产、多策略的量化配置理论，强化组合的韧性与适应性。权益资产配置方面，本基金严格依托自主研发的量化投资模型执行股票决策，有效分散非系统性风险，在复杂市场环境中持续稳定获取股票的超额收益。在债券资产配置方面，本基金根据利率周期与信用环境动态调整久期与仓位，在控制信用风险的前提下实施适度波段操作，有效提升组合的收益增强能力与波动平滑效果。

此外，本基金秉承尽职尽责的态度，认真应对投资者日常申购、赎回等工作，保障基金运作的稳定性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2026 年 6 月 30 日，华夏睿磐泰利混合 A 基金份额净值为 1.5209 元，本报告期份额净值增长率为 3.64%；华夏睿磐泰利混合 C 基金份额净值为 1.4856 元，本报告期份额净值增长率为 3.48%，同期业绩比较基准增长率为 3.61%。

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，股票市场预计延续结构性震荡上行格局，全面普涨难现，核心逻辑已从估值修复切换至产业景气和业绩兑现的双重验证，外部扰动带来的回调反而构成优质布局窗口。但是国际环境复杂，投资需要警惕油价波动及部分人工智能标的业绩不及预期的短期扰动，锚定真实产业趋势、避开纯题材炒作，仍是获取超额收益的核心思路。

展望下半年，债市大概率将转向“基本面交易”与“赔率博弈”的震荡偏强格局，财政退坡下，基本面数据预计延续走弱，收益率中枢有望小幅下行，但受制于政策预期及赔率空间较小，在机构行为扰动下，预计走势将较为震荡而非单边快速下行。

2026 年下半年，本基金将继续在稳定的投资目标与投资风格的指导下，持续优化与迭代投资框架与细分投资策略，在控制产品整体绝对回撤水平的前提下，践行绝对收益投资目标。基金管理人将持续秉承以客观来认识市场，通过系统化多策略的方式实践适配的资产配置，加强股票、债券、商品、汇率跨资产视角的交叉验证研究以及宏观、中观和微观跨视角的交叉验证研究，注重多资产收益之间的仓位合理分配，力争实现产品的投资目标。

基金管理人珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任，本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金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，中国光大银行股份有限公司在华夏睿磐泰利混合型证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面的运作严格依据基金合同的约定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司以自身能够获取的数据和信息为限，根据法律法规规定、基金合同和托管协议约定对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进行了复核，认为以上内容真实、准确、完整。

§6 中期报告财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华夏睿磐泰利混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	2,552,367.25	12,174,269.69

结算备付金		26,761,563.89	7,530,338.89
存出保证金		131,032.15	429,803.90
交易性金融资产	6.4.7.2	1,439,955,203.29	895,440,329.80
其中：股票投资		188,414,212.44	124,335,337.50
基金投资		-	-
债券投资		1,251,540,990.85	771,104,992.30
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	-	4,792,060.06
应收清算款		13,926,139.89	154,119,827.34
应收股利		-	-
应收申购款		801,791.81	1,066,536.11
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,484,128,098.28	1,075,553,165.79
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		290,670,000.00	121,600,000.00
应付清算款		-	1,897,188.43
应付赎回款		1,635,614.21	255,496,647.49
应付管理人报酬		586,883.84	491,118.66
应付托管费		97,813.98	81,853.12
应付销售服务费		165,065.65	104,689.18
应付投资顾问费		-	-
应交税费		57,851.47	35,265.27

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	773,570.85	1,344,388.06
负债合计		293,986,800.00	381,051,150.21
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	792,934,416.65	478,059,894.88
未分配利润	6.4.7.8	397,206,881.63	216,442,120.70
净资产合计		1,190,141,298.28	694,502,015.58
负债和净资产总计		1,484,128,098.28	1,075,553,165.79

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，华夏睿磐泰利混合 A 基金份额净值 1.5209 元，华夏睿磐泰利混合 C 基金份额净值 1.4856 元；华夏睿磐泰利混合基金份额总额 792,934,416.65 份（其中 A 类 344,474,435.86 份，C 类 448,459,980.79 份）。

6.2 利润表

会计主体：华夏睿磐泰利混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		39,738,997.82	31,203,315.47
1.利息收入		128,518.48	737,763.01
其中：存款利息收入	6.4.7.9	71,332.56	468,940.56
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		57,185.92	268,822.45
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		29,393,754.32	30,221,686.38
其中：股票投资收益	6.4.7.1 0	19,259,935.97	10,195,262.83
基金投资收益	6.4.7.1 1	-	-
债券投资收益	6.4.7.1 2	8,788,008.15	18,941,435.32

资产支持证券投资收益	6.4.7.1 3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.1 4	-	-
衍生工具收益	6.4.7.1 5	-	-978,189.41
股利收益	6.4.7.1 6	1,345,810.20	2,063,177.64
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 7	9,778,112.41	125,325.38
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 8	438,612.61	118,540.70
减：二、营业总支出		5,974,072.69	7,875,645.93
1.管理人报酬		3,181,725.15	5,265,765.11
2.托管费		530,287.57	877,627.48
3.销售服务费		886,135.85	605,732.71
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		1,244,957.33	997,629.88
其中：卖出回购金融资产支出		1,244,957.33	997,629.88
6.信用减值损失	6.4.7.2 0	-	-
7.税金及附加		30,543.93	23,506.92
8.其他费用	6.4.7.2 1	100,422.86	105,383.83
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		33,764,925.13	23,327,669.54
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		33,764,925.13	23,327,669.54
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		33,764,925.13	23,327,669.54

6.3 净资产变动表

会计主体：华夏睿磐泰利混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	478,059,894.88	216,442,120.70	694,502,015.58
二、本期期初净资产	478,059,894.88	216,442,120.70	694,502,015.58
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	314,874,521.77	180,764,760.93	495,639,282.70
（一）、综合收益总额	-	33,764,925.13	33,764,925.13
（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）	314,874,521.77	146,999,835.80	461,874,357.57
其中：1.基金申购款	542,199,881.84	255,464,188.10	797,664,069.94
2.基金赎回款	-227,325,360.07	-108,464,352.30	-335,789,712.37
（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	792,934,416.65	397,206,881.63	1,190,141,298.28
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,261,612,363.26	498,010,145.60	1,759,622,508.86
二、本期期初净资产	1,261,612,363.26	498,010,145.60	1,759,622,508.86
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	119,444,939.26	68,793,181.71	188,238,120.97
（一）、综合收益总额	-	23,327,669.54	23,327,669.54
（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）	119,444,939.26	45,465,512.17	164,910,451.43
其中：1.基金申购款	417,128,067.34	160,764,163.37	577,892,230.71
2.基金赎回款	-297,683,128.08	-115,298,651.20	-412,981,779.28
（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	1,381,057,302.52	566,803,327.31	1,947,860,629.83

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：邹迎光，主管会计工作负责人：朱威，会计机构负责人：朱威

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

原华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）已获中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2017]1560号《关于准予华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金注册的批复》，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为契约型、定期开放式，存续期限为不定期。本基金自2017年11月27日至2017年12月22日共募集236,001,759.07元（不含认购资金利息），业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2017）验字第60739337_A36号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金基金合同》于2017年12月27日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为236,086,689.29份基金份额，其中认购资金利息折合84,930.22份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金截至第二个开放期末日即2019年2月26日日终，基金资产净值低于5000万元，触发基金合同约定的转型条款，经与基金托管人中国光大银行股份有限公司协商一致，根据基金管理人2019年2月27日刊登的《华夏基金管理有限公司关于华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金触发转型条款并实施转型的公告》，自2019年2月27日起，“华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金”正式转型为“华夏睿磐泰利混合型证券投资基金”，转型后的华夏睿磐泰利混合型证券投资基金为每日开放申购、赎回、转换、定期定额申购业务的普通开放式基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华夏睿磐泰利混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板、存托凭证及其他中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、衍生品（包括权证、股指期货、股票期权、国债期货等）、货币市场工具（含同业存单）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。

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和修订的《企业会计准则——基本准则》、各项具体会计准则(以下合称“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”)发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》编制,同时在信息披露方面也参考了中国证监会、中国基金业协会发布的基金行业实务操作的其他有关规定。

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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

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

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、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《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[2015]125 号《财政部、国家税务总局、证监会关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、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[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法

实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 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交易，资管产品管理人为纳税人。自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税。

（2）自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，对公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入免征增值税；对证券投资基金从证券市场中取得的买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

（3）存款利息收入不征收增值税。

（4）自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，金融同业往来利息收入免征增值税。

（5）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。

（6）对基金取得的债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（7）基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

（8）对基金在境内取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。基金在境内从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，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，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。对香港市场投资者取得的股息、红利收入按照 10% 的税率代扣所得税。

（9）基金在境内卖出股票按 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。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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（10）基金在境外证券交易所进行交易或取得的源自境外证券市场的收益，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

(11) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%、2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

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	2,552,367.25
等于：本金	2,551,114.74
加：应计利息	1,252.51
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	2,552,367.25

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		186,054,174.80	-	188,414,212.44	2,360,037.64
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	587,554,006.33	5,498,526.56	594,129,316.56	1,076,783.67
	银行间市场	645,421,810.09	4,141,039.29	657,411,674.29	7,848,824.91
	合计	1,232,975,816.42	9,639,565.85	1,251,540,990.85	8,925,608.58

资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,419,029,991.22	9,639,565.85	1,439,955,203.29	11,285,646.22

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

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

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

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	369.72
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	636,378.27
其中：交易所市场	628,615.86
银行间市场	7,762.41
应付利息	-
预提费用	136,822.86
合计	773,570.85

6.4.7.7 实收基金

华夏睿磐泰利混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	256,701,131.18	256,701,131.18
本期申购	211,679,460.84	211,679,460.84
本期赎回（以“-”号填列）	-123,906,156.16	-123,906,156.16
本期末	344,474,435.86	344,474,435.86

华夏睿磐泰利混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	221,358,763.70	221,358,763.70
本期申购	330,520,421.00	330,520,421.00
本期赎回（以“-”号填列）	-103,419,203.91	-103,419,203.91
本期末	448,459,980.79	448,459,980.79

注：申购含红利再投（如有）、转换入份额（如有），赎回含转换出份额（如有）。

6.4.7.8 未分配利润

华夏睿磐泰利混合 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
上年度末	103,698,017.75	16,310,986.91	120,009,004.66
本期期初	103,698,017.75	16,310,986.91	120,009,004.66
本期利润	11,753,956.16	4,951,326.41	16,705,282.57
本期基金份额交易产生的变动数	37,491,874.86	5,216,708.22	42,708,583.08
其中：基金申购款	89,498,474.75	13,818,547.36	103,317,022.11
基金赎回款	-52,006,599.89	-8,601,839.14	-60,608,439.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	152,943,848.77	26,479,021.54	179,422,870.31

华夏睿磐泰利混合 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
----	-------	-------	---------

上年度末	82,405,146.69	14,027,969.35	96,433,116.04
本期期初	82,405,146.69	14,027,969.35	96,433,116.04
本期利润	12,232,856.56	4,826,786.00	17,059,642.56
本期基金份额交易产生的变动数	88,884,477.28	15,406,775.44	104,291,252.72
其中：基金申购款	129,576,410.80	22,570,755.19	152,147,165.99
基金赎回款	-40,691,933.52	-7,163,979.75	-47,855,913.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	183,522,480.53	34,261,530.79	217,784,011.32

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	43,652.44
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	26,771.25
其他	908.87
合计	71,332.56

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,584,305,533.97
减：卖出股票成本总额	1,563,418,751.39
减：交易费用	1,626,846.61
买卖股票差价收入	19,259,935.97

6.4.7.11 基金投资收益

无。

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1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	10,500,881.39
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,712,873.24
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	8,788,008.15

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1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	316,112,088.85
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	314,422,319.45
减：应计利息总额	3,391,082.38
减：交易费用	11,560.26
买卖债券差价收入	-1,712,873.24

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

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

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,345,810.20
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-

合计	1,345,810.20
----	--------------

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1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	9,778,112.41
——股票投资	-1,651,633.15
——债券投资	11,429,745.56
——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	9,778,112.41

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	438,612.61
合计	438,612.61

6.4.7.19 持有基金产生的费用

无。

6.4.7.20 信用减值损失

无。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	22,315.49

信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行间账户维护费	18,000.00
存托服务费	-
其他	600.00
合计	100,422.86

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，本基金无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无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

本基金本报告期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
华夏基金管理有限公司	基金管理人
中国光大银行股份有限公司（“中国光大银行”）	基金托管人
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东
上海华夏财富投资管理有限公司（“华夏财富”）	基金管理人的子公司
中信期货有限公司（“中信期货”）	基金管理人第一大股东的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 基金交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

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1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,181,725.15	5,265,765.11
其中：应支付销售机构的客户维护费	890,054.00	683,221.39
应支付基金管理人的净管理费	2,291,671.15	4,582,543.72

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬＝前一日基金资产净值×年费率/当年天数。

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的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，该费用按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算，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1月1日至2026年6月30 日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	530,287.57	877,627.48

注：①支付基金托管人的基金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。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费＝前一日基金资产净值×年费率/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期2026年1月1日至2026年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏睿磐泰利混合 A	华夏睿磐泰利混合 C	合计
华夏基金管理有限公司	-	239,070.57	239,070.57
华夏财富	-	13,187.50	13,187.50
中国光大银行	-	3,159.26	3,159.26
中信证券	-	7.23	7.23
中信期货	-	3.62	3.62
中信证券（华南）	-	-	-
中信证券（山东）	-	-	-
合计	-	255,428.18	255,428.18
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏睿磐泰利混合 A	华夏睿磐泰利混合 C	合计
华夏基金管理有限公司	-	145,628.51	145,628.51
中信证券	-	15,686.11	15,686.11
华夏财富	-	13,475.39	13,475.39
中国光大银行	-	5,777.06	5,777.06
中信证券（山东）	-	3,993.21	3,993.21
中信证券（华南）	-	1,763.57	1,763.57
中信期货	-	3.62	3.62
合计	-	186,327.47	186,327.47

注：①支付基金销售机构的基金销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。

②基金销售服务费计算公式为：C 类日基金销售服务费＝前一日 C 类基金资产净值×年费率/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

单位：人民币元

本期

2026年1月1日至2026年6月30日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国光大银行	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国光大银行	-	2,050,856.00	-	-	-	-

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

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

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

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

无。

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		上年度可比期间	
	2026年1月1日至2026年6月30日		2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国光大银行活期存款	2,552,367.25	43,652.44	151,496,825.76	170,769.74

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国光大银行保管，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

金额单位：人民币元

本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日				
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入

				数量（单位： 股/张）	总金额
中信证券	001248	华润新能源	新股发行	59,097	597,470.67
中信证券	688820	盛合晶微	新股发行	17,312	340,700.16
中信证券	688808	联讯仪器	新股发行	1,624	132,973.12
中信证券	688785	恒运昌	新股发行	1,155	106,467.90
中信证券	688797	臻宝科技	新股发行	2,070	92,239.20
中信证券	301683	慧谷新材	新股发行	952	74,617.76
中信证券	688811	有研复材	新股发行	8,337	53,440.17
中信证券	301669	高特电子	新股发行	5,455	38,621.40
中信证券	001312	福恩股份	新股发行	1,333	24,500.54
上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
中信证券	688775	影石创新	新股发行	5,725	270,620.75
中信证券	688583	思看科技	新股发行	1,742	58,287.32
中信证券	688755	汉邦科技	新股发行	2,023	46,063.71
中信证券	301662	宏工科技	新股发行	1,429	38,011.40
中信证券	603257	中国瑞林	新股发行	780	16,005.60
中信证券	603124	江南新材	新股发行	879	9,264.66

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	受限期	流通受 限类型	认购 价格	期末估 值单价	数量(单 位:股)	期末 成本总 额	期末 估值总 额	备注

688795	摩尔线程	2025-1 1-26	9 个月	新发 流通 受限	114.28	676.94	4,430	506,26 0.40	2,998,8 44.20	-
688802	沐曦股份	2025-1 2-09	9 个月	新发 流通 受限	104.66	768.89	3,228	337,84 2.48	2,481,9 76.92	-
301666	大普微	2026-0 4-08	6 个月	新发 流通 受限	46.08	463.33	1,220	56,217. 60	565,26 2.60	-
001248	华润新能源	2026-0 6-24	6 个月	新发 流通 受限	10.11	10.11	41,368	418,23 0.48	418,23 0.48	-
688790	昂瑞微	2025-1 2-09	9 个月	新发 流通 受限	83.06	126.45	2,319	192,61 6.14	293,23 7.55	-
688781	视涯科技	2026-0 3-18	9 个月	新发 流通 受限	22.68	42.16	6,335	143,67 7.80	267,08 3.60	-
688808	联讯仪器	2026-0 4-16	6 个月	新发 流通 受限	81.88	1,584.3 3	163	13,346. 44	258,24 5.79	-
688820	盛合晶微	2026-0 4-13	6 个月	新发 流通 受限	19.68	141.49	1,732	34,085. 76	245,06 0.68	-
001399	惠科股份	2026-0 6-16	6 个月	新发 流通 受限	10.12	27.73	6,488	65,658. 56	179,91 2.24	-
001248	华润新能源	2026-0 6-24	1 个月 内 (含)	新发 流通 受限	10.11	10.11	17,729	179,24 0.19	179,24 0.19	-
688818	电科蓝天	2026-0 2-03	6 个月	新发 流通 受限	9.47	70.14	1,717	16,259. 99	120,43 0.38	-
301682	宏明电子	2026-0 3-18	6 个月	新发 流通 受限	69.66	160.06	714	49,737. 24	114,28 2.84	-
688797	臻宝科技	2026-0 6-16	6 个月	新发 流通 受限	44.56	468.67	207	9,223.9 2	97,014. 69	-
688712	北芯生命	2026-0 1-28	6 个月	新发 流通 受限	17.52	35.92	1,500	26,280. 00	53,880. 00	-
688785	恒运昌	2026-0 1-20	6 个月	新发 流通 受限	92.18	463.15	116	10,692. 88	53,725. 40	-

688813	泰金 新能	2026-0 3-24	6 个月	新发 流通 受限	26.28	172.09	234	6,149.5 2	40,269. 06	-
688635	长进 光子	2026-0 5-20	6 个月	新发 流通 受限	40.98	308.19	128	5,245.4 4	39,448. 32	-
001257	盛龙 股份	2026-0 3-24	6 个月	新发 流通 受限	7.82	20.74	1,743	13,630. 26	36,149. 82	-
603459	红板 科技	2026-0 3-31	6 个月	新发 流通 受限	17.70	84.32	330	5,841.0 0	27,825. 60	-
001365	天海 电子	2026-0 5-11	6 个月	新发 流通 受限	27.19	31.31	719	19,549. 61	22,511. 89	-
688811	有研 复材	2026-0 4-01	6 个月	新发 流通 受限	6.41	24.13	834	5,345.9 4	20,124. 42	-
301696	三瑞 智能	2026-0 3-31	6 个月	新发 流通 受限	24.68	86.80	216	5,330.8 8	18,748. 80	-
001237	惠康 科技	2026-0 5-15	6 个月	新发 流通 受限	53.26	58.74	285	15,179. 10	16,740. 90	-
301669	高特 电子	2026-0 6-02	6 个月	新发 流通 受限	7.08	28.40	546	3,865.6 8	15,506. 40	-
301687	新广 益	2025-1 2-24	6 个月	新发 流通 受限	21.93	77.78	195	4,276.3 5	15,167. 10	-
001393	维通 利	2026-0 5-08	6 个月	新发 流通 受限	30.38	38.99	387	11,757. 06	15,089. 13	-
301531	春光 集团	2026-0 4-28	6 个月	新发 流通 受限	13.30	51.56	290	3,857.0 0	14,952. 40	-
301599	理奇 智能	2026-0 4-22	6 个月	新发 流通 受限	13.91	32.47	433	6,023.0 3	14,059. 51	-
301680	固德 电材	2026-0 2-27	6 个月	新发 流通 受限	58.00	112.16	117	6,786.0 0	13,122. 72	-
601112	振石 股份	2026-0 1-21	6 个月	新发 流通 受限	11.18	17.59	703	7,859.5 4	12,365. 77	-

301683	慧谷新材	2026-03-24	6 个月	新发流通受限	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
688816	易思维	2026-02-04	6 个月	新发流通受限	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
603407	长裕集团	2026-04-29	6 个月	新发流通受限	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
301513	尚水智能	2026-04-10	6 个月	新发流通受限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
920136	永励精密	2026-06-25	1 个月内 (含)	新发流通受限	19.28	19.28	300	5,784.00	5,784.00	-
603435	嘉德利	2026-05-15	6 个月	新发流通受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603352	至信股份	2026-01-08	6 个月	新发流通受限	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
920193	吉和昌	2026-06-18	1 个月内 (含)	新发流通受限	8.52	8.52	300	2,556.00	2,556.00	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6 个月	新发流通受限	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
001312	福恩股份	2026-04-14	6 个月	新发流通受限	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
920189	康美特	2026-06-30	1 个月内 (含)	新发流通受限	8.14	8.14	200	1,628.00	1,628.00	-
603284	林平发展	2026-02-03	6 个月	新发流通受限	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
001220	世盟股份	2026-01-27	6 个月	新发流通受限	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-

注：①根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

②基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

③根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

④基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的设定限售期的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026-06-29	重大事项	879.53	2026-07-13	890.99	1,000	506,490.17	879,530.00-	

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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 290,670,000.00 元，于 2026 年 7 月 1 日（先后）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

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

本基金的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、法律部、合规部、稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；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的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，参考压力测试结果，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围之内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低导致债券价格下降，或基金在交易过程中发生交收违约，而造成基金资产损失的可能性。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

本基金管理人通过限制投资集中度来管理投资品种变现的流动性风险。除在“6.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，本基金所投资的证券均能及时变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回规律相匹配。

在资产端，本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人持续监测本基金持有资产的市场交易量、交易集中度等涉及资产流动性水平的风险指标，并定期开展压力测试，详细评估在不同的压力情景下资产变现情况的变化。

在负债端，基金管理人持续监测本基金开放期内投资者历史申赎、投资者类型和结构变化等数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整组合资产结构及比例，预留充足现金头寸，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金管理人通过监测组合敏感性指标来衡量市场风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金管理人定期对组合中债券投资部分面临的利率风险进行监控，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	合计
货币资金	2,552,367.25	-	-	2,552,367.25
结算备付金	26,761,563.89	-	-	26,761,563.89
存出保证金	131,032.15	-	-	131,032.15
债券投资	102,327,047.76	807,107,816.75	342,106,126.34	1,251,540,990.85
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
应收直销申购款	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	290,670,000.00	-	-	290,670,000.00

上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
货币资金	12,174,269.69	-	-	12,174,269.69
结算备付金	7,530,338.89	-	-	7,530,338.89
存出保证金	429,803.90	-	-	429,803.90
债券投资	224,763,779.77	358,975,997.28	187,365,215.25	771,104,992.30
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	4,792,060.06	-	-	4,792,060.06
应收直销申购款	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	121,600,000.00	-	-	121,600,000.00

注：本表所示为本基金生息资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

		影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	利率下降 25 个基点	15,423,962.60	7,477,094.46
	利率上升 25 个基点	-15,123,136.13	-7,304,698.07

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素（单个证券发行主体自身经营情况或证券市场整体波动）发生变动时导致基金资产发生损失的风险。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本基金管理人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进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例(%)	公允价值	占基金资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	188,414,212.44	15.83	124,335,337.50	17.90
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	188,414,212.44	15.83	124,335,337.50	17.90

注：①本表中交易性金融资产-债券投资科目仅包含可转换公司债券和可交换公司债券等。

②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。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数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	上年度末

		2026 年 6 月 30 日	2025 年 12 月 31 日
	-5%	-10,635,567.03	-5,310,821.75
	+5%	10,635,567.03	5,310,821.75

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	178,836,883.98
第二层次	1,253,027,959.52
第三层次	8,090,359.79
合计	1,439,955,203.29

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内证券涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等导致流通受限的情况，本基金根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值所属层次。本基金政策以导致各层次之间转换的事项发生日作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

截至 2026 年 6 月 30 日止，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，其账面价值与公允价值差异很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	188,414,212.44	12.70
	其中：股票	188,414,212.44	12.70
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,251,540,990.85	84.33
	其中：债券	1,251,540,990.85	84.33
	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	29,313,931.14	1.98
8	其他各项资产	14,858,963.85	1.00
9	合计	1,484,128,098.28	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	509,494.80	0.04
B	采矿业	3,722,373.82	0.31
C	制造业	125,325,341.49	10.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,454,446.07	0.37
E	建筑业	3,524,840.00	0.30
F	批发和零售业	5,179,249.00	0.44
G	交通运输、仓储和邮政业	6,628,282.46	0.56
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,894,855.00	1.34

J	金融业	17,040,766.80	1.43
K	房地产业	140,415.00	0.01
L	租赁和商务服务业	1,083,361.00	0.09
M	科学研究和技术服务业	1,119,877.00	0.09
N	水利、环境和公共设施管理业	1,432,770.00	0.12
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,325,910.00	0.11
Q	卫生和社会工作	422,226.00	0.04
R	文化、体育和娱乐业	610,004.00	0.05
S	综合	-	-
	合计	188,414,212.44	15.83

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 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	688002	睿创微纳	25,500	3,944,595.00	0.33
2	002379	宏桥控股	224,400	3,314,388.00	0.28
3	688111	金山办公	15,500	3,302,275.00	0.28
4	688235	百济神州	11,900	3,029,859.00	0.25
5	688795	摩尔线程	4,430	2,998,844.20	0.25
6	301371	敷尔佳	111,500	2,899,000.00	0.24
7	688127	蓝特光学	29,300	2,859,680.00	0.24
8	688008	澜起科技	9,200	2,851,080.00	0.24
9	688279	峰岬科技	12,500	2,805,500.00	0.24
10	002738	中矿资源	44,400	2,619,156.00	0.22
11	688802	沐曦股份	3,228	2,481,976.92	0.21
12	688498	源杰科技	1,200	2,263,200.00	0.19
13	001309	德明利	2,400	2,262,960.00	0.19
14	300857	协创数据	6,500	2,209,350.00	0.19
15	688486	龙迅股份	34,100	2,168,078.00	0.18

16	000878	云南铜业	130,000	2,064,400.00	0.17
17	601601	中国太保	72,200	2,059,144.00	0.17
18	300919	中伟新材	46,400	2,030,000.00	0.17
19	688220	翱捷科技	16,200	2,013,984.00	0.17
20	301479	弘景光电	33,000	1,986,600.00	0.17
21	601336	新华保险	33,200	1,980,712.00	0.17
22	300604	长川科技	5,800	1,980,236.00	0.17
23	601668	中国建筑	421,700	1,830,178.00	0.15
24	000829	天音控股	234,100	1,825,980.00	0.15
25	688311	盟升电子	63,700	1,668,303.00	0.14
26	300861	美畅股份	63,500	1,599,565.00	0.13
27	002544	普天科技	86,500	1,576,030.00	0.13
28	301665	泰禾股份	74,400	1,559,424.00	0.13
29	300073	当升科技	31,700	1,522,868.00	0.13
30	301608	博实结	30,200	1,517,852.00	0.13
31	300663	科蓝软件	226,800	1,510,488.00	0.13
32	301061	匠心家居	42,970	1,506,957.90	0.13
33	601328	交通银行	231,100	1,485,973.00	0.12
34	688503	聚和材料	10,900	1,446,430.00	0.12
35	000408	藏格矿业	20,600	1,427,992.00	0.12
36	001210	金房能源	62,600	1,423,524.00	0.12
37	000166	申万宏源	316,162	1,391,112.80	0.12
38	688301	奕瑞科技	10,700	1,326,800.00	0.11
39	300492	华图山鼎	38,600	1,325,910.00	0.11
40	300207	欣旺达	69,700	1,323,603.00	0.11
41	600026	中远海能	73,300	1,315,002.00	0.11
42	301589	诺瓦星云	8,700	1,296,126.00	0.11
43	301219	腾远钴业	23,390	1,281,772.00	0.11
44	002850	科达利	6,700	1,268,310.00	0.11
45	300953	震裕科技	9,400	1,256,780.00	0.11

46	688522	纳睿雷达	62,600	1,253,252.00	0.11
47	002487	大金重工	21,600	1,252,152.00	0.11
48	002271	东方雨虹	103,800	1,232,106.00	0.10
49	605222	起帆电缆	52,500	1,224,300.00	0.10
50	000001	平安银行	121,700	1,223,085.00	0.10
51	000975	山金国际	71,800	1,220,600.00	0.10
52	603124	江南新材	6,500	1,215,370.00	0.10
53	300475	香农芯创	4,000	1,200,000.00	0.10
54	002645	华宏科技	43,400	1,193,934.00	0.10
55	300259	新天科技	179,500	1,190,085.00	0.10
56	301328	维峰电子	16,480	1,173,376.00	0.10
57	603699	纽威股份	23,100	1,161,930.00	0.10
58	688778	厦钨新能	21,200	1,153,280.00	0.10
59	002023	海特高新	86,800	1,124,928.00	0.09
60	002716	湖南白银	134,700	1,089,723.00	0.09
61	300351	永贵电器	65,525	1,081,162.50	0.09
62	600519	贵州茅台	900	1,066,941.00	0.09
63	600018	上港集团	222,100	1,048,312.00	0.09
64	300650	太龙股份	70,600	1,025,818.00	0.09
65	300055	万邦达	158,516	1,019,257.88	0.09
66	688166	博瑞医药	29,000	1,015,290.00	0.09
67	601998	中信银行	144,800	1,003,464.00	0.08
68	600331	宏达股份	90,800	997,892.00	0.08
69	000895	双汇发展	44,400	994,560.00	0.08
70	688309	恒誉环保	16,300	992,344.00	0.08
71	300774	倍杰特	91,800	986,850.00	0.08
72	002557	洽洽食品	54,500	978,820.00	0.08
73	300775	三角防务	44,400	978,576.00	0.08
74	002352	顺丰控股	31,000	969,060.00	0.08
75	688371	菲沃泰	24,800	966,952.00	0.08

76	301556	托普云农	16,500	964,590.00	0.08
77	002400	省广集团	147,500	930,725.00	0.08
78	603091	众鑫股份	19,080	930,531.60	0.08
79	600233	圆通速递	58,200	916,650.00	0.08
80	600367	红星发展	14,300	899,899.00	0.08
81	002947	恒铭达	11,700	889,785.00	0.07
82	688072	拓荆科技	1,000	879,530.00	0.07
83	601390	中国中铁	210,700	878,619.00	0.07
84	688536	思瑞浦	2,400	873,816.00	0.07
85	601658	邮储银行	176,100	868,173.00	0.07
86	000603	盛达资源	37,500	866,250.00	0.07
87	002865	钧达股份	14,100	841,488.00	0.07
88	601615	明阳智能	70,500	815,685.00	0.07
89	000776	广发证券	34,700	811,980.00	0.07
90	002032	苏泊尔	20,500	811,800.00	0.07
91	301387	光大同创	8,600	794,812.00	0.07
92	600036	招商银行	22,300	791,650.00	0.07
93	002558	巨人网络	28,700	790,972.00	0.07
94	000538	云南白药	16,500	781,605.00	0.07
95	001389	广合科技	3,170	752,082.50	0.06
96	300855	图南股份	23,800	743,988.00	0.06
97	600016	民生银行	229,900	740,278.00	0.06
98	600722	金牛化工	89,800	729,176.00	0.06
99	688575	亚辉龙	82,400	721,824.00	0.06
100	601169	北京银行	146,500	717,850.00	0.06
101	688017	绿的谐波	1,700	710,362.00	0.06
102	688702	盛科通信	1,800	701,982.00	0.06
103	300136	信维通信	5,600	667,800.00	0.06
104	001286	陕西能源	63,700	645,918.00	0.05
105	688347	华虹宏力	1,900	638,970.00	0.05

106	601212	白银有色	125,300	636,524.00	0.05
107	688689	银河微电	9,500	614,840.00	0.05
108	001248	华润新能源	59,097	597,470.67	0.05
109	600720	中交设计	121,600	586,112.00	0.05
110	003816	中国广核	148,000	578,680.00	0.05
111	688138	清溢光电	12,200	573,400.00	0.05
112	600999	招商证券	27,100	571,810.00	0.05
113	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.05
114	688653	康希通信	30,600	531,828.00	0.04
115	600223	福瑞达	104,900	527,647.00	0.04
116	688385	复旦微电	7,200	513,288.00	0.04
117	601006	大秦铁路	102,900	474,369.00	0.04
118	300957	贝泰妮	14,700	463,197.00	0.04
119	000999	华润三九	20,200	454,298.00	0.04
120	600116	三峡水利	78,400	439,040.00	0.04
121	000059	华锦股份	116,800	438,000.00	0.04
122	688012	中微公司	900	421,650.00	0.04
123	601800	中国交建	73,800	421,398.00	0.04
124	301090	华润材料	65,300	409,431.00	0.03
125	600177	雅戈尔	53,900	405,867.00	0.03
126	600088	中视传媒	36,800	400,752.00	0.03
127	600028	中国石化	89,100	397,386.00	0.03
128	000728	国元证券	52,800	395,472.00	0.03
129	001872	招商港口	20,100	390,543.00	0.03
130	688225	亚信安全	31,200	387,504.00	0.03
131	600901	江苏金租	67,300	386,975.00	0.03
132	688120	华海清科	1,200	386,616.00	0.03
133	603365	水星家纺	23,600	367,452.00	0.03
134	301239	普瑞眼科	11,800	359,310.00	0.03
135	002810	山东赫达	14,311	353,481.70	0.03

136	603619	中曼石油	18,600	348,006.00	0.03
137	600075	新疆天业	85,400	345,016.00	0.03
138	688378	奥来德	5,500	341,000.00	0.03
139	000333	美的集团	4,500	339,885.00	0.03
140	600132	重庆啤酒	7,900	326,270.00	0.03
141	601688	华泰证券	15,800	325,796.00	0.03
142	688655	迅捷兴	6,000	321,360.00	0.03
143	002237	恒邦股份	21,800	320,242.00	0.03
144	600703	三安光电	15,000	318,300.00	0.03
145	300234	开尔新材	27,000	316,440.00	0.03
146	300970	华绿生物	16,810	307,286.80	0.03
147	688686	奥普特	1,800	303,102.00	0.03
148	688027	国盾量子	600	302,406.00	0.03
149	688790	昂瑞微	2,319	293,237.55	0.02
150	002497	雅化集团	14,200	289,254.00	0.02
151	000049	德赛电池	11,700	273,429.00	0.02
152	601288	农业银行	44,600	270,722.00	0.02
153	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.02
154	001313	粤海饲料	37,200	263,748.00	0.02
155	600988	赤峰黄金	10,000	263,200.00	0.02
156	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.02
157	000703	恒逸石化	18,400	249,688.00	0.02
158	688820	盛合晶微	1,732	245,060.68	0.02
159	301123	奕东电子	2,000	241,440.00	0.02
160	688449	联芸科技	2,700	233,037.00	0.02
161	688543	国科军工	5,900	232,755.00	0.02
162	605056	咸亨国际	14,300	228,800.00	0.02
163	301096	百诚医药	3,900	223,041.00	0.02
164	002756	永兴材料	3,900	220,896.00	0.02
165	000626	远大控股	34,600	219,018.00	0.02

166	002736	国信证券	21,800	217,782.00	0.02
167	000429	粤高速 A	15,900	217,035.00	0.02
168	300571	平治信息	4,700	214,602.00	0.02
169	688667	菱电电控	1,600	213,840.00	0.02
170	601166	兴业银行	12,800	211,968.00	0.02
171	301308	江波龙	300	211,140.00	0.02
172	603153	上海建科	16,600	210,488.00	0.02
173	688693	锆威特	2,000	207,900.00	0.02
174	688380	中微半导	3,100	204,321.00	0.02
175	301559	中集环科	16,600	202,354.00	0.02
176	002772	众兴菌业	17,800	202,208.00	0.02
177	301113	雅艺科技	13,430	200,241.30	0.02
178	001218	丽臣实业	8,900	196,334.00	0.02
179	002838	道恩股份	6,400	195,968.00	0.02
180	002745	木林森	15,500	194,525.00	0.02
181	002966	苏州银行	27,900	194,184.00	0.02
182	600500	中化国际	24,700	193,401.00	0.02
183	300390	天华新能	2,000	187,020.00	0.02
184	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.02
185	300779	惠城环保	3,520	176,704.00	0.01
186	000623	吉林敖东	9,800	173,754.00	0.01
187	605577	龙版传媒	19,600	172,676.00	0.01
188	301227	森鹰窗业	6,800	171,428.00	0.01
189	688709	成都华微	4,500	171,405.00	0.01
190	601186	中国铁建	28,500	169,575.00	0.01
191	300257	开山股份	5,900	169,212.00	0.01
192	600655	豫园股份	40,800	167,688.00	0.01
193	600971	恒源煤电	24,000	165,600.00	0.01
194	000967	盈峰环境	15,700	165,321.00	0.01
195	601326	秦港股份	51,400	162,424.00	0.01

196	300599	雄塑科技	16,100	162,127.00	0.01
197	002948	青岛银行	31,900	162,052.00	0.01
198	002225	濮耐股份	34,200	161,766.00	0.01
199	300124	汇川技术	2,400	159,192.00	0.01
200	688355	明志科技	8,200	157,850.00	0.01
201	605369	拱东医疗	8,700	152,598.00	0.01
202	601333	广深铁路	55,400	152,350.00	0.01
203	688212	澳华内镜	5,100	149,940.00	0.01
204	000410	沈阳机床	32,300	149,872.00	0.01
205	003012	东鹏控股	34,300	149,548.00	0.01
206	001965	招商公路	16,300	149,308.00	0.01
207	600623	华谊集团	18,500	149,295.00	0.01
208	002957	科瑞技术	2,700	148,068.00	0.01
209	300224	正海磁材	11,000	146,630.00	0.01
210	002327	富安娜	24,300	144,342.00	0.01
211	600196	复星医药	6,400	143,808.00	0.01
212	688023	安恒信息	3,900	143,208.00	0.01
213	601009	南京银行	14,400	142,416.00	0.01
214	000987	越秀资本	18,200	142,324.00	0.01
215	600903	贵州燃气	21,400	142,096.00	0.01
216	600820	隧道股份	27,000	140,670.00	0.01
217	601717	中创智领	10,100	140,491.00	0.01
218	600649	城投控股	40,700	140,415.00	0.01
219	603235	天新药业	6,300	140,175.00	0.01
220	300973	立高食品	5,700	140,049.00	0.01
221	605116	奥锐特	7,400	140,008.00	0.01
222	688030	山石网科	8,800	138,952.00	0.01
223	000848	承德露露	18,700	138,380.00	0.01
224	603848	好太太	10,100	137,966.00	0.01
225	300463	迈克生物	16,700	137,942.00	0.01

226	603328	依顿电子	11,000	137,830.00	0.01
227	601860	紫金银行	56,800	137,456.00	0.01
228	601200	上海环境	20,800	137,280.00	0.01
229	600017	日照港	54,900	137,250.00	0.01
230	002701	奥瑞金	32,200	137,172.00	0.01
231	600908	无锡银行	27,000	137,160.00	0.01
232	002818	富森美	13,200	137,148.00	0.01
233	600645	中源协和	8,000	136,880.00	0.01
234	600648	外高桥	17,100	136,629.00	0.01
235	601228	广州港	48,400	136,488.00	0.01
236	000563	陕国投 A	49,400	136,344.00	0.01
237	600351	亚宝药业	23,700	136,275.00	0.01
238	600874	创业环保	25,400	136,144.00	0.01
239	002839	张家港行	34,900	136,110.00	0.01
240	002573	清新环境	46,100	135,534.00	0.01
241	600125	铁龙物流	26,600	134,862.00	0.01
242	603348	文灿股份	10,000	133,900.00	0.01
243	300575	中旗股份	27,200	133,824.00	0.01
244	301262	海看股份	7,400	132,978.00	0.01
245	605339	南侨食品	11,100	132,534.00	0.01
246	002780	三夫户外	10,900	132,326.00	0.01
247	600008	首创环保	48,600	132,192.00	0.01
248	600098	广州发展	21,900	129,429.00	0.01
249	600968	海油发展	38,000	126,540.00	0.01
250	002142	宁波银行	4,200	124,698.00	0.01
251	301321	翰博高新	2,800	123,620.00	0.01
252	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.01
253	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.01
254	688615	合合信息	1,000	113,100.00	0.01
255	688400	凌云光	1,700	112,540.00	0.01

256	000401	金隅冀东	33,500	111,890.00	0.01
257	688696	极米科技	1,700	109,718.00	0.01
258	601827	三峰环境	15,000	109,050.00	0.01
259	600717	天津港	27,900	108,531.00	0.01
260	603231	索宝蛋白	7,300	108,040.00	0.01
261	601995	中金公司	2,900	104,835.00	0.01
262	600583	海油工程	20,300	102,109.00	0.01
263	002043	兔宝宝	9,100	100,828.00	0.01
264	001338	永顺泰	11,800	99,002.00	0.01
265	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.01
266	601919	中远海控	7,300	96,798.00	0.01
267	603408	建霖家居	9,600	92,640.00	0.01
268	300756	金马游乐	2,800	92,540.00	0.01
269	600771	广誉远	7,100	91,945.00	0.01
270	000828	东莞控股	9,800	91,728.00	0.01
271	603689	皖天然气	13,200	91,476.00	0.01
272	002959	小熊电器	2,800	88,816.00	0.01
273	300347	泰格医药	1,800	86,400.00	0.01
274	600155	华创云信	15,600	86,112.00	0.01
275	300783	三只松鼠	5,100	80,580.00	0.01
276	688548	广钢气体	1,500	78,150.00	0.01
277	301280	珠城科技	1,500	75,855.00	0.01
278	688150	莱特光电	1,100	75,482.00	0.01
279	300658	延江股份	6,400	73,152.00	0.01
280	601117	中国化学	9,600	70,560.00	0.01
281	601238	广汽集团	13,600	69,088.00	0.01
282	300859	西域旅游	2,400	64,056.00	0.01
283	601107	四川成渝	13,100	63,928.00	0.01
284	301103	何氏眼科	4,200	62,916.00	0.01
285	601816	京沪高铁	13,700	62,061.00	0.01

286	000778	新兴铸管	16,300	60,473.00	0.01
287	688211	中科微至	1,700	58,514.00	0.00
288	601158	重庆水务	15,100	58,286.00	0.00
289	603285	键邦股份	1,300	58,253.00	0.00
290	002975	博杰股份	400	56,800.00	0.00
291	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
292	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
293	001299	美能能源	5,340	53,720.40	0.00
294	688580	伟思医疗	1,000	53,270.00	0.00
295	002758	浙农股份	6,700	52,930.00	0.00
296	600704	物产中大	11,200	52,864.00	0.00
297	601319	中国人保	7,800	52,728.00	0.00
298	001323	慕思股份	3,300	52,140.00	0.00
299	000655	金岭矿业	8,100	51,516.00	0.00
300	301536	星宸科技	400	51,484.00	0.00
301	688600	皖仪科技	1,500	49,920.00	0.00
302	603196	璞源材料	2,000	48,880.00	0.00
303	002092	中泰化学	12,600	48,258.00	0.00
304	605499	东鹏饮料	360	44,434.80	0.00
305	600511	国药股份	1,700	44,268.00	0.00
306	600809	山西汾酒	400	43,748.00	0.00
307	300893	松原安全	2,700	43,740.00	0.00
308	600547	山东黄金	1,800	41,562.00	0.00
309	002270	华明装备	2,200	41,470.00	0.00
310	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
311	600867	通化东宝	5,000	40,200.00	0.00
312	300164	通源石油	5,000	40,000.00	0.00
313	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
314	000719	中原传媒	3,200	36,576.00	0.00
315	301468	博盈特焊	870	36,287.70	0.00

316	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
317	002155	湖南黄金	1,500	35,805.00	0.00
318	002508	老板电器	2,400	35,088.00	0.00
319	002929	润建股份	500	33,440.00	0.00
320	301448	开创电气	700	31,766.00	0.00
321	301366	一博科技	500	30,585.00	0.00
322	601398	工商银行	4,300	30,401.00	0.00
323	300905	宝丽迪	600	30,360.00	0.00
324	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
325	300191	潜能恒信	1,000	27,650.00	0.00
326	600900	长江电力	1,000	26,470.00	0.00
327	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
328	000858	五粮液	300	22,200.00	0.00
329	688811	有研新材	834	20,124.42	0.00
330	301178	天亿马	380	18,905.00	0.00
331	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
332	300132	青松股份	3,200	18,176.00	0.00
333	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
334	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
335	002027	分众传媒	3,200	15,488.00	0.00
336	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
337	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
338	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
339	603216	梦天家居	700	14,399.00	0.00
340	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
341	600234	科新发展	500	13,840.00	0.00
342	688265	南模生物	400	13,836.00	0.00
343	600361	创新新材	3,800	13,680.00	0.00
344	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
345	688135	利扬芯片	300	12,624.00	0.00

346	601112	振石股份	703	12,365.77	0.00
347	600278	东方创业	2,100	12,348.00	0.00
348	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
349	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
350	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
351	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
352	920136	永励精密	300	5,784.00	0.00
353	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
354	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
355	920193	吉和昌	300	2,556.00	0.00
356	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
357	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
358	920189	康美特	200	1,628.00	0.00
359	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
360	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601668	中国建筑	16,191,315.00	2.33
2	000923	河钢资源	14,615,769.32	2.10
3	000776	广发证券	12,632,876.00	1.82
4	000878	云南铜业	11,454,280.00	1.65
5	002371	北方华创	11,206,129.00	1.61
6	688235	百济神州	9,778,847.97	1.41
7	000001	平安银行	9,744,307.00	1.40
8	601390	中国中铁	9,459,820.00	1.36
9	688127	蓝特光学	8,788,770.63	1.27
10	688002	睿创微纳	8,423,358.66	1.21
11	000166	申万宏源	8,346,232.00	1.20

12	688019	安集科技	8,210,141.31	1.18
13	301328	维峰电子	8,015,186.40	1.15
14	300132	青松股份	7,997,269.00	1.15
15	002028	思源电气	7,661,119.00	1.10
16	688111	金山办公	7,437,773.37	1.07
17	601658	邮储银行	6,912,760.00	1.00
18	301090	华润材料	6,903,094.00	0.99
19	301608	博实结	6,886,934.00	0.99
20	600704	物产中大	6,880,747.00	0.99

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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601668	中国建筑	19,338,287.16	2.78
2	000923	河钢资源	14,273,905.96	2.06
3	000776	广发证券	13,860,100.00	2.00
4	000001	平安银行	12,192,292.00	1.76
5	002371	北方华创	11,132,364.00	1.60
6	688235	百济神州	10,309,219.13	1.48
7	000878	云南铜业	9,511,565.00	1.37
8	600015	华夏银行	8,525,831.00	1.23
9	301328	维峰电子	8,477,106.00	1.22
10	601390	中国中铁	8,225,882.00	1.18
11	300132	青松股份	8,021,097.00	1.15
12	002736	国信证券	7,768,018.80	1.12
13	002028	思源电气	7,710,915.00	1.11
14	688019	安集科技	7,670,524.18	1.10
15	000166	申万宏源	7,415,518.00	1.07
16	688506	百利天恒	7,037,966.67	1.01
17	600704	物产中大	6,798,430.00	0.98

18	002803	吉宏股份	6,764,893.00	0.97
19	603379	三美股份	6,558,625.02	0.94
20	688213	思特威	6,487,495.72	0.93

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	1,629,149,259.48
卖出股票收入（成交）总额	1,584,305,533.97

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	157,095,510.54	13.20
2	央行票据	-	-
3	金融债券	149,343,045.75	12.55
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	399,813,503.05	33.59
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	545,288,931.51	45.82
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,251,540,990.85	105.16

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	019742	24 特国 01	700,000	74,785,008.22	6.28
2	019827	26 国债 01	562,000	56,564,283.78	4.75
3	312610003	26 农行 TLAC 非资	500,000	50,874,063.01	4.27

		本债 01C(BC)			
4	102680541	26 鲁高速 MTN003	500,000	50,787,131.51	4.27
5	102680458	26 紫金投资 MTN001(科 创债)	500,000	50,662,400.00	4.26

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

本基金本报告期末无股指期货投资。

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

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 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

本基金本报告期末未持有基金。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

7.13.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。

7.13.3 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	131,032.15

2	应收清算款	13,926,139.89
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	801,791.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,858,963.85

7.13.4 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。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例（%）	流通受限情况说明
1	688795	摩尔线程	2,998,844.20	0.25	新发流通受限

7.13.6 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	占总份额比 例	持有份额	占总份额比 例
华夏睿磐泰利混合 A	516,131	667.42	199,325,752.94	57.86%	145,148,682.92	42.14%
华夏睿磐泰利混合 C	117,152	3,828.02	335,135,436.56	74.73%	113,324,544.23	25.27%
合计	633,283	1,252.10	534,461,189.50	67.40%	258,473,227.15	32.60%

注：本章节持有人户数合计按份额级别汇总，未予以合并剔重。

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
----	--------------------------------------

盈利投资者数量占比	93.76%
-----------	--------

注：盈利投资者数量占比=盈利投资者数量/投资者总数

其中，投资者指指标计算期间持有过基金份额的投资者，盈利投资者指投资者区间净收益不小于零的投资者。

投资者区间净收益=投资者区间收益-基金交易手续费（认申购费、赎回费、转换费等）。其中，区间收益=持有期末市值-持有期初市值+（赎回+转出+非交易过户出）-（认购+申购+定投+转入+非交易过户入）+现金分红

该指标计算时剔除持有期限不满 7 日的交易。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	华夏睿磐泰利混合 A	673,605.79	0.20%
	华夏睿磐泰利混合 C	831.83	0.00%
	合计	674,437.62	0.09%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华夏睿磐泰利混合 A	0
	华夏睿磐泰利混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华夏睿磐泰利混合 A	10~50
	华夏睿磐泰利混合 C	0
	合计	10~50

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏睿磐泰利混合 A	华夏睿磐泰利混合 C
基金合同生效日（2017 年 12 月 27 日）基金份额总额	29,272,313.05	19,062,398.32
本报告期期初基金份额总额	256,701,131.18	221,358,763.70
本报告期基金总申购份额	211,679,460.84	330,520,421.00
减：本报告期基金总赎回份额	123,906,156.16	103,419,203.91
本报告期基金拆分变动份额	-	-

本报告期末基金份额总额	344,474,435.86	448,459,980.79
-------------	----------------	----------------

§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

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生影响基金管理人经营或公募基金运营业务的诉讼。

本报告期无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人未受到调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

方正证券	1	1,708,072,143.27	53.22%	334,628.97	53.23%	-
中信建投证券	1	1,499,328,750.25	46.71%	293,721.29	46.73%	-
华泰证券	1	2,124,858.40	0.07%	265.60	0.04%	-
中国银河证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择研究服务证券公司的标准，即：

i 投研部门根据证券公司的总体资质情况、财务状况、研究服务能力、经营行为及风控合规能力等情况，选择证券公司进入交易合作库，并进行跟踪评估，对合作库证券公司进行调整。

ii 投研部门牵头制定证券公司研究服务评价制度，建立健全对证券公司研究服务的定期评价机制。评价指标包括但不限于：业绩贡献、反馈速度、观点或数据质量等。

②为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择交易服务证券公司的标准，即：

i 投资部门根据证券公司的总体资质、财务状况、经营行为和合规风控能力、交易服务能力等情况，选择证券公司进入交易合作库，并进行跟踪监控，对合作库证券公司进行调整。

ii 投资部门牵头制定证券公司交易服务评价制度，建立健全对证券公司交易服务的定期评价机制。

iii 投资部门定期对证券公司的交易服务开展评价，评价指标包括但不限于：交易服务成本、交易服务能力、交易系统稳定性、交易系统支持能力、应急交易能力等。

③证券公司专用交易单元选择程序：

i 投资、研究部门牵头制定规范、合理的合作证券公司管理制度，明确证券公司准入标准、退出程序等。合规管理部门对合作证券公司管理制度进行合规性审查。

ii 投资、研究部门根据上述标准进行评估并确定选用的证券公司。

iii 本基金管理人与被选择的证券公司签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

④除本表列示外，本基金还选择了财通证券、长城证券、长江证券、东方财富证券、东海证券、东兴证券、广发证券、华创证券、华金证券、华林证券、华鑫证券、开源证券、上海证券、申万宏源证券、世纪证券、兴业证券、招商证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

⑤本报告期内，本基金租用的券商交易单元未发生变更。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名	债券交易	债券回购交易	权证交易	基金交易
-----	------	--------	------	------

称	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
方正证 券	6,490.68	0.00%	510,688,000.00	2.36%	-	-	-	-
中信建 投证券	95,747,325.00	41.53%	21,162,395,000.00	97.64%	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国银 河证券	70,388,530.00	30.53%	-	-	-	-	-	-
中金公 司	64,383,730.00	27.93%	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-01-22
2	华夏睿磐泰利混合型证券投资基金限制申购、定期定额申购及转换转入业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-01-29
3	华夏睿磐泰利混合型证券投资基金调整申购、定期定额申购及转换转入业务上限的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-02-02
4	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-03-26
5	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-03
6	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-15
7	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-16
8	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-18
9	华夏睿磐泰利混合型证券投资基金调整申购、定期定额申购及转换转入业务上限的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-23
10	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-23
11	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-05-13
12	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-06-04

13	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-06-18
14	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-06-26

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2026-01-01 至 2026-01-25	100,298,080.27	-	-	100,298,080.27	12.65%
产品特有风险							

本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。

在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、基金合同；
- 3、托管协议；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司

二〇二六年八月三十一日