

华宝量化选股混合型发起式证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中信证券股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
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	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	60
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	60
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	60

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	60
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
7.12 投资组合报告附注	60
§ 8 基金份额持有人信息	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
8.2 盈利投资者数量占比	62
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
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	62
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况	62
§ 9 开放式基金份额变动	62
§ 10 重大事件揭示	63
10.1 基金份额持有人大会决议	63
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	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
10.4 基金投资策略的改变	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	63
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	64
10.8 其他重大事件	64
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	65
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	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	66
§ 12 备查文件目录	66
12.1 备查文件目录	66
12.2 存放地点	66
12.3 查阅方式	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝量化选股混合型发起式证券投资基金	
基金简称	华宝量化选股混合发起式	
基金主代码	017715	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 2 月 20 日	
基金管理人	华宝基金管理有限公司	
基金托管人	中信证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	106,712,396.71 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华宝量化选股混合发起式 A	华宝量化选股混合发起式 C
下属分级基金的交易代码	017715	017716
报告期末下属分级基金的份额总额	26,151,647.73 份	80,560,748.98 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，通过量化投资精选股票，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	主要考虑估值、成长、盈利质量、市场预期等基本面因子以及业绩超预期等事件驱动因子，通过实证分析和动态跟踪得到有效因子，再根据有效因子的综合评分结果，在全市场中选择股票构建股票投资组合。所选股票具备较高的市场认可度、成长水平、盈利质量等，具备对全 A 优质股的综合表征能力。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是一只主动投资的混合型基金，其长期平均预期风险和预期收益率理论上低于股票型基金，高于债券型基金、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		华宝基金管理有限公司	中信证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周雷	杨军智
	联系电话	021-38505888	010-60834299
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	yjz@citics.com
客户服务电话		400-700-5588、400-820-5050	010-60836588
传真		021-38505777	010-60834004
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区世	北京市朝阳区亮马桥路 48 号中

	纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	信证券大厦 5 层
邮政编码	200120	100125
法定代表人	夏雪松	张佑君

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.fsfund.com
基金中期报告置备地点	基金管理人办公场所和基金托管人办公场所。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	基金管理人	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)	
	华宝量化选股混合发起式 A	华宝量化选股混合发起式 C
本期已实现收益	1, 421, 838. 62	5, 222, 124. 40
本期利润	-596, 011. 19	114, 652. 04
加权平均基金份 额本期利润	-0. 0226	0. 0013
本期加权平均净 值利润率	-1. 48%	0. 09%
本期基金份额净 值增长率	0. 92%	0. 72%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	11, 078, 148. 22	32, 598, 813. 20
期末可供分配基 金份额利润	0. 4236	0. 4046
期末基金资产净 值	37, 229, 795. 95	113, 159, 562. 18

期末基金份额净值	1.4236	1.4046
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	42.36%	40.46%

- 注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润等于本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
3. 净值相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。
4. 期末可供分配利润采用资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华宝量化选股混合发起式 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	-3.40%	1.14%	15.02%	1.32%	-18.42%	-0.18%
过去六个月	0.92%	1.23%	17.22%	1.33%	-16.30%	-0.10%
过去一年	20.25%	1.06%	41.31%	1.14%	-21.06%	-0.08%
过去三年	39.76%	1.33%	44.07%	1.18%	-4.31%	0.15%
过去五年	-	-	-	-	-	-
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	42.36%	1.28%	40.36%	1.14%	2.00%	0.14%

华宝量化选股混合发起式 C

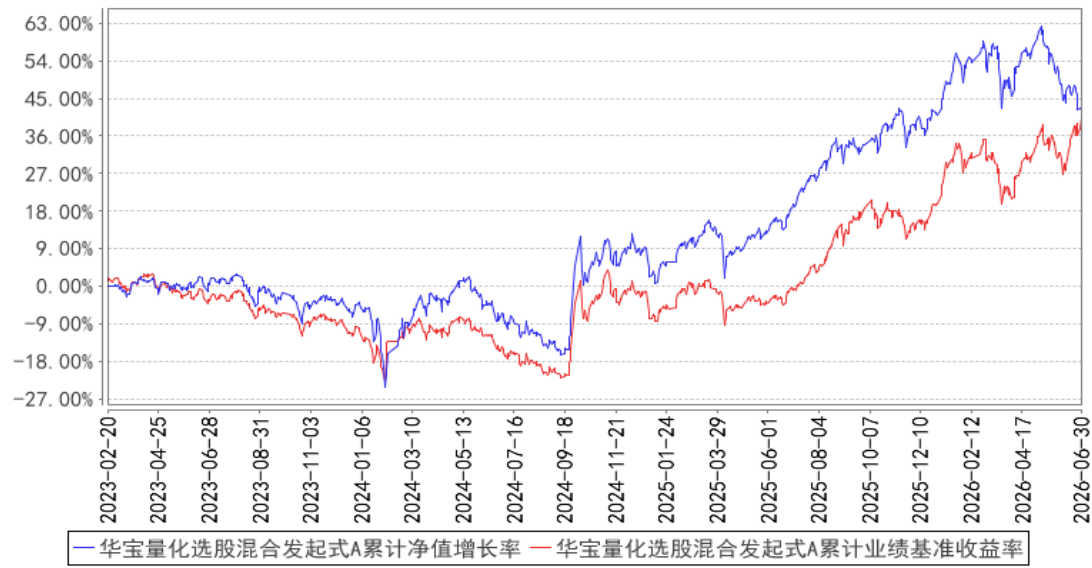
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-3.50%	1.14%	15.02%	1.32%	-18.52%	-0.18%

过去六个月	0.72%	1.23%	17.22%	1.33%	-16.50%	-0.10%
过去一年	19.77%	1.06%	41.31%	1.14%	-21.54%	-0.08%
过去三年	38.10%	1.33%	44.07%	1.18%	-5.97%	0.15%
过去五年	-	-	-	-	-	-
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同 生效起至今	40.46%	1.28%	40.36%	1.14%	0.10%	0.14%

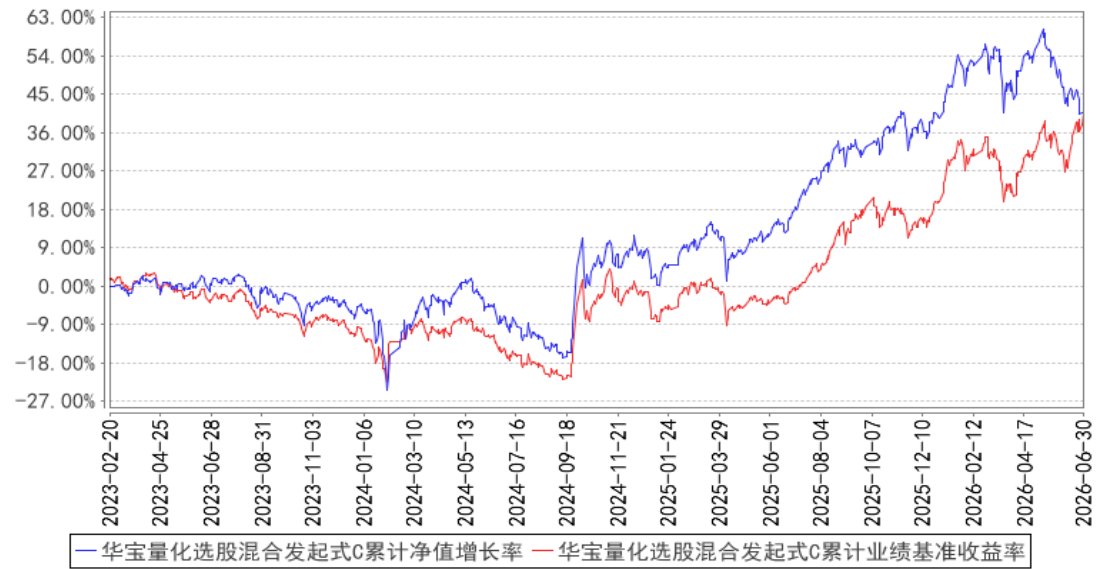
注：（1）基金业绩基准：中证 500 指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%；
（2）净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

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

华宝量化选股混合发起式A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



华宝量化选股混合发起式C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势图



注：按照基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定，截至 2023 年 08 月 20 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华宝基金管理有限公司（公司原名“华宝兴业基金管理有限公司”）于 2003 年 2 月 12 日经中国证监会批准设立，2003 年 3 月 7 日在国家工商总局注册登记并正式开业，是国内首批中外合资基金管理公司。成立之初，公司注册资本为 1 亿元人民币，2007 年经中国证监会批准，公司注册资本增加至 1.5 亿元人民币。2017 年公司名称变更为“华宝基金管理有限公司”。目前公司股东为华宝信托有限责任公司、美国华平资产管理有限合伙（Warburg Pincus Asset Management, L.P.）和江苏省铁路集团有限公司，持有股权占比分别为 51%、29%、20%。公司在北京和深圳设有分公司。截至本报告期末（2026 年 06 月 30 日），本公司正在管理运作的公开募集证券投资基金共 178 只，涵盖股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金、FOF 等。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
喻银尤	本基金基金经理	2023-02-20	-	10 年	硕士。曾在中信建投证券股份有限公司从事量化研究工作，2018 年 9 月加入华宝基金管理有限公司，历任量化分析师、投资经理等职务。2022 年 7 月至 2026 年

					1 月任华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理，2023 年 2 月起任华宝量化选股混合型发起式证券投资基金基金经理，2025 年 3 月至 2026 年 4 月任华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2025 年 6 月起任华宝中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理，2025 年 9 月起任华宝上证科创板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金联接基金（原：华宝上证科创板综合指数增强型证券投资基金）基金经理，2026 年 3 月起任华宝价值发现混合型证券投资基金基金经理，2026 年 5 月起任华宝上证科创板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
徐林明	本基金基金经理、量化投资总监、量化投资部总经理	2023-02-20	-	24 年	硕士。曾在兴业证券、凯龙财经（上海）有限公司、中原证券从事金融工程研究工作。2005 年 8 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任金融工程部数量分析师、金融工程部副总经理等职务，现任量化投资总监、量化投资部总经理。2009 年 9 月至 2015 年 11 月任华宝中证 100 指数证券投资基金基金经理，2010 年 4 月至 2015 年 11 月任上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2014 年 9 月起任华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金基金经理，2015 年 4 月至 2020 年 2 月任华宝事件驱动混合型证券投资基金基金经理，2016 年 12 月至 2026 年 1 月任华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理，2019 年 2 月至 2022 年 10 月任华宝科技先锋混合型证券投资基金基金经理，2021 年 12 月至 2023 年 11 月任华宝中证稀有金属主题指数增强型发起式证券投资基金基金经理，2022 年 8 月至 2023 年 11 月任华宝高端装备股票型发起式证券投资基金基金经理，2023 年 2 月起任华宝量化选股混合型发起式证券投资基金基金经理，2025 年 6 月起任华宝中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理，2025 年 12 月起任华宝沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2026 年 1 月起任

					华宝沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期内，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，本基金没有发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年 A 股极致分化，科技成长板块一枝独秀，传统行业则普遍低迷。市场成交保持活跃，资金高度聚焦人工智能、半导体等新质生产力方向，而消费、地产、金融等权重板块持续承压。

指数间严重背离，创业板与科创板表现远强于主板，多数个股跑输指数，赚钱效应集中于少数领域。政策持续加码科技创新，但经济复苏基础尚不牢固，外部不确定性扰动频繁，市场风险偏好起伏较大，整体呈现鲜明的结构性行情特征。

本基金采取多策略模型，不赌风格、不押赛道、不追热点，全市场均衡量化选股策略。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额 A 类净值增长率为 0.92%，本报告期基金份额 C 类净值增长率为 0.72%；同期业绩比较基准收益率为 17.22%。

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，宏观经济在政策托底下有望企稳，但经济结构“K 型分化”特征或将延续。政策定调“加大逆周期调节力度”，财政与产业政策协同发力，广义财政支出有望温和回升。证券市场方面，行情核心驱动力正从上半年的“拔估值”切换至“业绩兑现”。预计将呈现结构性行情，风格趋于均衡。行业走势上，AI 与科技或仍将是市场主线，但板块内部分化加剧，投资逻辑将高度聚焦。除科技主线外，可关注 AI 资本支出外溢的衍生板块（如数据中心、电力设备等），以及锂电池、化工等正经历盈利复苏的领域。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中信证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在对华宝量化选股混合型发起式证券投资基金（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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、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的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本报告期，由华宝基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关华宝量化选股混合型发起式证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华宝量化选股混合型发起式证券投资基金

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	3,505,359.81	2,768,906.19
结算备付金		6,362,173.92	4,319,173.95

存出保证金		-	435,484.80
交易性金融资产	6.4.7.2	141,215,845.42	111,196,900.72
其中：股票投资		141,215,845.42	111,196,900.72
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		47,304.06	5,075,257.74
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		151,130,683.21	123,795,723.40
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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		473,044.25	364,248.35
应付管理人报酬		158,934.07	47,114.11
应付托管费		26,489.03	7,852.37
应付销售服务费		39,815.15	6,965.44
应付投资顾问费		-	-
应交税费		81.90	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	42,960.68	56,001.68
负债合计		741,325.08	482,181.95
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	106,712,396.71	88,212,238.81
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	43,676,961.42	35,101,302.64

净资产合计		150,389,358.13	123,313,541.45
负债和净资产总计		151,130,683.21	123,795,723.40

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 106,712,396.71 份，其中华宝量化选股混合发起式 A 基金份额总额 26,151,647.73 份，基金份额净值 1.4236 元；华宝量化选股混合发起式 C 基金份额总额 80,560,748.98 份，基金份额净值 1.4046 元。

6.2 利润表

会计主体：华宝量化选股混合型发起式证券投资基金

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		1,044,549.96	4,242,163.58
1. 利息收入		46,896.87	8,293.22
其中：存款利息收入	6.4.7.9	46,896.87	8,293.22
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		7,687,613.90	2,159,220.37
其中：股票投资收益	6.4.7.10	5,949,245.90	1,964,412.28
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	608,130.90	-124,674.35
股利收益	6.4.7.15	1,130,237.10	319,482.44
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-7,125,322.17	2,054,088.69
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 17	435, 361. 36	20, 561. 30
减：二、营业总支出		1, 525, 909. 11	310, 071. 55
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	1, 040, 008. 26	209, 222. 03
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	173, 334. 76	34, 870. 34
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	267, 316. 44	28, 090. 46
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 18	-	-
7. 税金及附加		2, 202. 43	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 19	43, 047. 22	37, 888. 72
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-481, 359. 15	3, 932, 092. 03
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-481, 359. 15	3, 932, 092. 03
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-481, 359. 15	3, 932, 092. 03

6.3 净资产变动表

会计主体：华宝量化选股混合型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	88, 212, 238. 81	-	35, 101, 302. 64	123, 313, 541. 45
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	88, 212, 238. 81	-	35, 101, 302. 64	123, 313, 541. 45
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	18, 500, 157. 90	-	8, 575, 658. 78	27, 075, 816. 68

(一)、综合收益总额	-	-	-481,359.15	-481,359.15
(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)	18,500,157.90	-	9,057,017.93	27,557,175.83
其中:1.基金申购款	207,995,138.93	-	107,942,444.22	315,937,583.15
2.基金赎回款	-189,494,981.03	-	-98,885,426.29	-288,380,407.32
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	106,712,396.71	-	43,676,961.42	150,389,358.13
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	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	42,664,734.97	-	2,626,725.75	45,291,460.72
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	42,664,734.97	-	2,626,725.75	45,291,460.72
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-15,636,593.46	-	2,244,328.80	-13,392,264.66
(一)、综合收益总额	-	-	3,932,092.03	3,932,092.03
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变	-15,636,593.46	-	-1,687,763.23	-17,324,356.69

动数（净资产减少以“-”号填列）				
其中：1. 基金申购款	10,710,126.17	-	993,447.17	11,703,573.34
2. 基金赎回款	-26,346,719.63	-	-2,681,210.40	-29,027,930.03
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	27,028,141.51	-	4,871,054.55	31,899,196.06

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：

<u>向辉</u>	<u>李孟恒</u>	<u>张幸骏</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华宝量化选股混合型发起式证券投资基金（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[2022]3112 号文《关于准予华宝量化选股混合型发起式证券投资基金注册的批复》准予注册，由华宝基金管理有限公司于 2023 年 2 月 15 日至 2023 年 2 月 16 日止期间向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2022）验字第 61471289_B03 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2023 年 2 月 20 日生效。本基金为契约型开放式、发起式，存续期限不定。设立时募集扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 93,956,514.37 元，其中 A 类基金份额的净认购金额为人民币 19,740,148.53 元；C 类基金份额的净认购金额为人民币 74,216,365.84 元。在募集期间产生利息为人民币 8,787.96 元，其中 A 类基金份额的有效认购资金在初始销售期内产生的利息为人民币 2,031.92 元；C 类基金份额的有效认购资金在初始销售期内产生的利息为人民币 6,756.04

元。以上收到的实收资金（本息）共计人民币 93,965,302.33 元，折合 93,965,302.33 份基金份额。本基金的基金管理人与注册登记机构为华宝基金管理有限公司，基金托管人为中信证券股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝量化选股混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、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、政府支持债券、地方政府债、可转换债券（含分离交易可转换债）、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、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：基金资产的 60%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率 $\times$ 80%+中证综合债指数收益率 $\times$ 20%。

本财务报表由本基金的基金管理人华宝基金管理有限公司于 2026 年 8 月 27 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》、《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

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财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净资产变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[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[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、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号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《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[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2024年第8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 本基金管理人运营本基金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。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，截至2027年12月31日，免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自2025年8月8日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融

债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b) 对本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。

对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对本基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）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。对本基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

d) 本基金卖出股票按 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。

e) 对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本基金管理人所在地适用的税率，计算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	3,505,359.81
等于：本金	3,503,819.72
加：应计利息	1,540.09
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
-	-
其他存款	-

等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	3,505,359.81

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		148,709,374.89	-	141,215,845.42	-7,493,529.47
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		148,709,374.89	-	141,215,845.42	-7,493,529.47

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	214.61
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-

银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	42,647.22
其他	98.85
合计	42,960.68

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

华宝量化选股混合发起式 A

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	18,361,315.86	18,361,315.86
本期申购	33,360,164.65	33,360,164.65
本期赎回（以“-”号填列）	-25,569,832.78	-25,569,832.78
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	26,151,647.73	26,151,647.73

华宝量化选股混合发起式 C

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	69,850,922.95	69,850,922.95
本期申购	174,634,974.28	174,634,974.28
本期赎回（以“-”号填列）	-163,925,148.25	-163,925,148.25
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	80,560,748.98	80,560,748.98

注：申购含红利再投以及转换入份(金)额，赎回含转换出份(金)额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

华宝量化选股混合发起式 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,566,850.74	-27,229.68	7,539,621.06
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	7,566,850.74	-27,229.68	7,539,621.06
本期利润	1,421,838.62	-2,017,849.81	-596,011.19

本期基金份额交易产生的变动数	3,779,873.82	354,664.53	4,134,538.35
其中：基金申购款	16,924,511.59	703,165.86	17,627,677.45
基金赎回款	-13,144,637.77	-348,501.33	-13,493,139.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,768,563.18	-1,690,414.96	11,078,148.22

华宝量化选股混合发起式 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	27,670,973.73	-109,292.15	27,561,681.58
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	27,670,973.73	-109,292.15	27,561,681.58
本期利润	5,222,124.40	-5,107,472.36	114,652.04
本期基金份额交易产生的变动数	4,850,193.98	72,285.60	4,922,479.58
其中：基金申购款	86,348,354.69	3,966,412.08	90,314,766.77
基金赎回款	-81,498,160.71	-3,894,126.48	-85,392,287.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	37,743,292.11	-5,144,478.91	32,598,813.20

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	41,588.87
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	5,120.76
其他	187.24
合计	46,896.87

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	939,448,825.28
减：卖出股票成本总额	932,256,370.90
减：交易费用	1,243,208.48
买卖股票差价收入	5,949,245.90

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

6.4.7.13.1 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	608,130.90

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,130,237.10
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	1,130,237.10

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-7,128,490.17
股票投资	-7,128,490.17
债券投资	—
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	3,168.00
权证投资	—

期货投资	3,168.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动 产生的预估增值税	-
合计	-7,125,322.17

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	433,149.15
基金转换费收入	2,212.21
合计	435,361.36

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	2,975.64
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
其他	400.00
合计	43,047.22

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华宝基金管理有限公司（“华宝基金”）	基金管理人，注册登记机构，基金销售机构
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金托管人，基金销售机构
华宝信托有限责任公司（“华宝信托”）	基金管理人的股东
华平资产管理有限合伙（Warburg Pincus Asset Management.L.P.）	基金管理人的股东

江苏省铁路集团有限公司(“江苏铁集”)	基金管理人的股东
中国宝武钢铁集团有限公司(“宝武集团”)	华宝信托的最终控制人
华宝证券股份有限公司(“华宝证券”)	受宝武集团控制的公司, 基金销售机构
华宝投资有限公司(“华宝投资”)	受宝武集团控制的公司
宝武集团财务有限责任公司(“宝武财务”)	受宝武集团控制的公司
华宝稳健优选三个月持有期混合型基金中基金 (FOF)	本基金的基金管理人管理的其他基金

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金 额	占当期股票 成交总额的 比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
中信证券	-	-	236, 109, 238. 25	100. 00

6.4.10.1.2 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1月1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 (%)
-	-	-	-	-
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 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 (%)
中信证券	126, 284. 11	100. 00	-	-

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

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，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，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；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 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	1,040,008.26	209,222.03
其中：应支付销售机构的客户维护费	230,066.92	63,580.54
应支付基金管理人的净管理费	809,941.34	145,641.49

注：支付基金管理人华宝基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.2%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 ×1.2% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	173,334.76	34,870.34

注：支付基金托管人中信证券的托管费按前一日基金资产净值 0.2%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.2% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华宝量化选股混合发起式 A	华宝量化选股混合发起式 C	合计
华宝基金	-	71,987.38	71,987.38
华宝证券	-	54,972.10	54,972.10

中信证券	-	17,534.39	17,534.39
合计	-	144,493.87	144,493.87
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		
	华宝量化选股混合发起式 A	华宝量化选股混合发起式 C	合计
华宝基金	-	1,338.95	1,338.95
中信证券	-	23,208.19	23,208.19
合计	-	24,547.14	24,547.14

注：销售服务费每日计提，按月支付。A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.4% 年费率计提。本基金 C 类基金份额销售服务费计提的计算方法如下： $H=E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$ ，H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费 E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	华宝量化选股混合发起式 A	华宝量化选股混合发起式 C
基金合同生效日（2023 年 2 月 20 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有	9,901,031.35	100,010.42

的基金份额		
报告期间申购/ 买入总份额	6,689,184.66	0.00
报告期间因拆 分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎 回/卖出总份额	9,901,031.35	100,010.42
报告期末持有 的基金份额	6,689,184.66	0.00
报告期末持有 的基金份额 占基金总份 额比例	25.58%	0.00%
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	华宝量化选股混合发起式 A	华宝量化选股混合发起式 C
基金合同生效 日（2023 年 2 月 20 日）持有 的基金份额	-	-
报告期初持有 的基金份额	9,901,031.35	100,010.42
报告期间申购/ 买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆 分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎 回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有 的基金份额	9,901,031.35	100,010.42
报告期末持有 的基金份额 占基金总份 额比例	54.59%	1.12%

注：基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

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

份额单位：份

华宝量化选股混合发起式 A

关联方名 称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例（%）

招商银行股份有限公司－华宝稳健优选三个月持有期混合型基金中基金（FOF）	2,000,000.00	7.65	—	—
--------------------------------------	--------------	------	---	---

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 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
中信证券－活期	3,505,359.81	41,588.87	937,685.55	7,064.35

注：本基金的银行存款存放于由基金托管人在具有基金托管资格的商业银行开立的账户，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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	688797	臻宝科技	网下新股	631	28,117.36
中信证券	001248	华润新能源	网下新股	8,242	83,326.62
中信证券	301669	高特电子	网下新股	3,538	25,049.04
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
—	—	—	—	—	—

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：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
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定	53.26	58.74	91	4,846.66	5,345.34	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新股流通受限	10.11	10.11	2,472	24,991.92	24,991.92	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	6 个月	新股锁定	10.11	10.11	5,770	58,334.70	58,334.70	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定	7.82	20.74	659	5,153.38	13,667.66	-
001365	天海电子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	新股锁定	27.19	31.31	216	5,873.04	6,762.96	-
001393	维通利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新股锁定	30.38	38.99	152	4,617.76	5,926.48	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定	10.12	27.73	844	8,541.28	23,404.12	-
301513	尚水智能	2026 年 4 月 10 日	6 个月	新股锁定	26.66	50.96	119	3,172.54	6,064.24	-
301531	春光	2026 年 4	6 个月	新股锁定	13.30	51.56	237	3,152.10	12,219.72	-

	集团	月 28 日								
301599	理奇智能	2026 年 4 月 22 日	6 个月	新股锁定	13.91	32.47	268	3,727.88	8,701.96	-
301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新股锁定	46.08	463.33	262	12,072.96	121,392.46	-
301669	高特电子	2026 年 6 月 2 日	6 个月	新股锁定	7.08	28.40	354	2,506.32	10,053.60	-
301680	固德电材	2026 年 2 月 27 日	6 个月	新股锁定	58.00	112.16	35	2,030.00	3,925.60	-
301682	宏明电子	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股锁定	69.66	160.06	149	10,379.34	23,848.94	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定	24.68	86.80	101	2,492.68	8,766.80	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股锁定	33.49	33.93	33	1,105.17	1,119.69	-
603407	长裕集团	2026 年 4 月 29 日	6 个月	新股锁定	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定	15.76	46.71	100	1,576.00	4,671.00	-
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	新股锁定	40.98	308.19	88	3,606.24	27,120.72	-
688797	臻宝	2026 年 6 月	6 个月	新股锁定	44.56	468.67	64	2,851.84	29,994.88	-

	科 技	月 16 日								
--	--------	-----------	--	--	--	--	--	--	--	--

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购，因此没有在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购，因此没有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只混合型的证券投资基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票、债券等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司内部监督和反馈系统包括内部控制委员会、督察长、合规审计部、风险管理部、各部门负责人和风险控制联络人、各业务岗位。内部控制委员会负责对公司经营管理活动和基金运作中的风险进行评估并研究制订相应的控制制度。督察长向董事会负责，总管公司的内控事务并独立地就内部控制制度的执行情况履行检查、评价、报告和建议职能。风险管理部在督察长指导下对公司内部控制运行情况进行监控，主要针对公司内部控制制度的总体构架和内部控制的目标进行评估并提出改进意见；合规审计部在督察长的领导下对各部门和岗位的内部控制执行情况进行监督和核查，同时对内控的失控点进行查漏并责令改正。

本基金的基金管理人根据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的四层监控防线。第一层监控防线为一线岗位自控与互控；第二层防线为大业务板块内部各部门和部门之间的自控和互控；第三层监控防线为风险管理部和合规审计部对各岗位、各部门、各项业务全面实施的监

督反馈；最后是以内部控制委员会为主体的第四层防线，实施对公司各类业务和风险的总体监督、控制，并对风险管理部和合规审计部的工作予以直接指导。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法是通过结合定性分析和定量分析方法，估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具的特征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定相应置信程度和风险损失的限度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在承受的范围之内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款均存放于大型股份制商业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于本报告期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金净资产的比例较低（含债券投资比例为零），因此无重大信用风险（上年度末：同）。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于本报告期末，除附注中列示的卖出回购金融资产款将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。（上

年度末：同）

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

本报告期内，基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理。本基金所持大部分证券在证券交易所上市或银行间同业市场交易，不存在具有重大流动性风险的投资品种。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度，按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为货币资金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	3,505,359.81	-	-	-	3,505,359.81
结算备付金	6,362,173.92	-	-	-	6,362,173.92
交易性金融资产	-	-	-	141,215,845.42	141,215,845.42
应收申购款	-	-	-	47,304.06	47,304.06
资产总计	9,867,533.73	-	-	141,263,149.48	151,130,683.21
负债					
应付赎回款	-	-	-	473,044.25	473,044.25
应付管理人报酬	-	-	-	158,934.07	158,934.07
应付托管费	-	-	-	26,489.03	26,489.03
应付销售服务费	-	-	-	39,815.15	39,815.15
应交税费	-	-	-	81.90	81.90
其他负债	-	-	-	42,960.68	42,960.68
负债总计	-	-	-	741,325.08	741,325.08
利率敏感度缺口	9,867,533.73	-	-	140,521,824.40	150,389,358.13
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,768,906.19	-	-	-	2,768,906.19
结算备付金	4,319,173.95	-	-	-	4,319,173.95
存出保证金	-	-	-	435,484.80	435,484.80
交易性金融资产	-	-	-	111,196,900.72	111,196,900.72
应收申购款	-	-	-	5,075,257.74	5,075,257.74
资产总计	7,088,080.14	-	-	116,707,643.26	123,795,723.40

负债					
应付赎回款	-	-	-	364,248.35	364,248.35
应付管理人报酬	-	-	-	47,114.11	47,114.11
应付托管费	-	-	-	7,852.37	7,852.37
应付销售服务费	-	-	-	6,965.44	6,965.44
其他负债	-	-	-	56,001.68	56,001.68
负债总计	-	-	-	482,181.95	482,181.95
利率敏感度缺口	7,088,080.14	-	-	-116,225,461.31	123,313,541.45

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金未持有交易性债券投资(上年度末：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(上年度末：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的股票投资比例为基金资产的 60%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	141,215,845.42	93.90	111,196,900.72	90.17
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	141,215,845.42	93.90	111,196,900.72	90.17

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 除业绩比较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）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	5,526,274.53	5,574,996.21
	业绩比较基准下降 5%	-5,526,274.53	-5,574,996.21

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	140,809,468.61	111,173,257.72
第二层次	83,326.62	23,643.00
第三层次	323,050.19	-
合计	141,215,845.42	111,196,900.72

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的证券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关证券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	141,215,845.42	93.44
	其中：股票	141,215,845.42	93.44
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	9,867,533.73	6.53
8	其他各项资产	47,304.06	0.03
9	合计	151,130,683.21	100.00

注：本基金本报告期末“固定收益投资”、“买入返售金融资产”、“银行存款和结算备付金合计”等项目的列报金额已包含对应的“应计利息”和“减值准备”（若有），“其他资产”中的“应收利息”指本基金截至本报告期末已过付息期但尚未收到的利息金额（下同）。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	5,841,125.73	3.88
B	采矿业	3,680,044.66	2.45
C	制造业	88,269,087.17	58.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,794,735.62	3.85
E	建筑业	561,944.00	0.37
F	批发和零售业	7,058,086.30	4.69
G	交通运输、仓储和邮政业	4,489,591.00	2.99
H	住宿和餐饮业	68,362.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,822,547.41	6.53
J	金融业	3,343,949.80	2.22
K	房地产业	4,490,563.00	2.99
L	租赁和商务服务业	2,365,127.20	1.57
M	科学研究和技术服务业	1,002,494.05	0.67
N	水利、环境和公共设施管理业	1,630,949.00	1.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	338,286.00	0.22
Q	卫生和社会工作	375,231.00	0.25
R	文化、体育和娱乐业	2,083,721.48	1.39
S	综合	-	-
	合计	141,215,845.42	93.90

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	600872	中炬高新	121,500	2,109,240.00	1.40
2	603345	安井食品	26,000	2,084,940.00	1.39
3	603817	海峡环保	403,300	2,060,863.00	1.37
4	603387	基蛋生物	264,700	2,001,132.00	1.33
5	600037	歌华有线	316,400	1,983,828.00	1.32
6	603233	大参林	128,300	1,928,349.00	1.28
7	600540	新赛股份	581,900	1,926,089.00	1.28
8	600029	南方航空	367,800	1,905,204.00	1.27
9	603100	川仪股份	104,800	1,891,640.00	1.26
10	600267	海正药业	177,300	1,792,503.00	1.19
11	300556	丝路视觉	103,100	1,790,847.00	1.19
12	300169	天晟新材	346,000	1,726,540.00	1.15
13	002319	乐通股份	163,100	1,683,192.00	1.12
14	300971	博亚精工	79,100	1,476,006.00	0.98
15	300094	国联水产	598,900	1,467,305.00	0.98
16	300970	华绿生物	79,950	1,461,486.00	0.97
17	300106	西部牧业	145,500	1,431,720.00	0.95
18	002748	世龙实业	135,900	1,424,232.00	0.95
19	300358	楚天科技	177,500	1,420,000.00	0.94
20	002313	日海智能	191,800	1,403,976.00	0.93
21	301118	恒光股份	51,300	1,396,899.00	0.93
22	300996	普联软件	126,200	1,374,318.00	0.91
23	002712	思美传媒	328,700	1,364,105.00	0.91
24	300933	中辰股份	221,900	1,349,152.00	0.90
25	000301	东方盛虹	117,600	1,346,520.00	0.90
26	002557	洽洽食品	74,700	1,341,612.00	0.89
27	002216	三全食品	116,100	1,338,633.00	0.89
28	002715	登云股份	100,900	1,336,925.00	0.89
29	002154	报喜鸟	372,300	1,325,388.00	0.88
30	000589	贵州轮胎	326,000	1,323,560.00	0.88
31	000990	诚志股份	161,800	1,323,524.00	0.88
32	300511	雪榕生物	262,311	1,319,424.33	0.88
33	001914	招商积余	160,800	1,312,128.00	0.87
34	002493	荣盛石化	117,800	1,266,350.00	0.84
35	002648	卫星化学	53,900	1,266,111.00	0.84
36	000703	恒逸石化	91,000	1,234,870.00	0.82

37	603223	恒通股份	92,100	1,201,905.00	0.80
38	002563	森马服饰	212,000	1,068,480.00	0.71
39	000983	山西焦煤	181,200	1,050,960.00	0.70
40	002867	周大生	93,300	1,040,295.00	0.69
41	601233	桐昆股份	45,900	993,735.00	0.66
42	688021	奥福科技	48,606	941,012.16	0.63
43	601588	北辰实业	582,100	931,360.00	0.62
44	600955	维远股份	62,900	925,888.00	0.62
45	688266	泽璟制药	7,832	913,681.12	0.61
46	603518	锦泓集团	120,900	864,435.00	0.57
47	603026	石大胜华	9,600	857,952.00	0.57
48	002289	宇顺电子	20,000	850,000.00	0.57
49	603906	龙蟠科技	32,000	848,960.00	0.56
50	600688	上海石化	282,700	828,311.00	0.55
51	600603	广汇物流	190,000	826,500.00	0.55
52	601101	昊华能源	76,200	804,672.00	0.54
53	603901	永创智能	69,400	754,378.00	0.50
54	600157	永泰能源	451,100	726,271.00	0.48
55	600397	江钨装备	26,500	721,595.00	0.48
56	600715	文投控股	460,099	699,350.48	0.47
57	600266	城建发展	176,600	690,506.00	0.46
58	300390	天华新能	7,300	682,623.00	0.45
59	601921	浙版传媒	101,500	679,035.00	0.45
60	688550	瑞联新材	10,959	633,978.15	0.42
61	002780	三夫户外	50,600	614,284.00	0.41
62	688486	龙迅股份	9,518	605,154.44	0.40
63	688111	金山办公	2,717	578,856.85	0.38
64	002132	恒星科技	106,800	577,788.00	0.38
65	688347	华虹宏力	1,702	572,382.60	0.38
66	600233	圆通速递	36,200	570,150.00	0.38
67	300575	中旗股份	115,100	566,292.00	0.38
68	603341	龙旗科技	12,900	548,121.00	0.36
69	000599	青岛双星	129,600	546,912.00	0.36
70	600755	厦门国贸	100,600	545,252.00	0.36
71	601333	广深铁路	195,800	538,450.00	0.36
72	600166	福田汽车	184,100	535,731.00	0.36
73	300405	科隆股份	103,300	535,094.00	0.36
74	600927	永安期货	42,600	530,370.00	0.35
75	605366	宏柏新材	38,400	500,352.00	0.33
76	603999	读者传媒	98,300	491,500.00	0.33
77	300865	大宏立	21,900	478,515.00	0.32
78	688221	前沿生物	21,107	472,796.80	0.31
79	601997	贵阳银行	90,100	462,213.00	0.31

80	300823	建科智能	31,000	451,980.00	0.30
81	600467	好当家	227,400	447,978.00	0.30
82	603602	纵横通信	40,100	441,902.00	0.29
83	002862	实丰文化	34,400	441,352.00	0.29
84	002998	优彩资源	66,700	434,217.00	0.29
85	688498	源杰科技	223	420,578.00	0.28
86	002848	高斯贝尔	29,700	413,424.00	0.27
87	600508	上海能源	55,900	411,983.00	0.27
88	600252	中恒集团	234,000	411,840.00	0.27
89	600971	恒源煤电	59,600	411,240.00	0.27
90	600740	山西焦化	128,600	410,234.00	0.27
91	600887	伊利股份	17,100	409,716.00	0.27
92	600733	北汽蓝谷	84,100	409,567.00	0.27
93	603317	天味食品	31,460	409,294.60	0.27
94	002407	多氟多	8,100	406,863.00	0.27
95	600123	兰花科创	75,700	404,238.00	0.27
96	688656	浩欧博	4,157	402,272.89	0.27
97	301156	美农生物	37,000	402,190.00	0.27
98	000504	南华生物	55,600	400,320.00	0.27
99	000809	和展能源	125,500	397,835.00	0.26
100	002855	捷荣技术	41,600	395,200.00	0.26
101	001366	播恩集团	36,200	392,408.00	0.26
102	000692	惠天热电	99,300	391,242.00	0.26
103	002591	恒大高新	63,400	388,008.00	0.26
104	300438	鹏辉能源	4,600	381,110.00	0.25
105	603399	永杉锂业	16,900	379,912.00	0.25
106	001309	德明利	400	377,160.00	0.25
107	600711	盛屯矿业	32,400	355,428.00	0.24
108	002419	天虹股份	83,900	354,897.00	0.24
109	600595	中孚实业	62,300	350,126.00	0.23
110	301358	湖南裕能	4,400	333,828.00	0.22
111	000421	南京公用	66,100	327,856.00	0.22
112	000404	长虹华意	39,200	308,112.00	0.20
113	601128	常熟银行	52,440	305,200.80	0.20
114	000567	海德股份	50,800	303,276.00	0.20
115	002266	浙富控股	59,200	299,552.00	0.20
116	300821	东岳硅材	14,400	296,064.00	0.20
117	001266	宏英智能	5,900	289,690.00	0.19
118	603776	永安行	13,500	281,745.00	0.19
119	002054	德美化工	42,300	281,295.00	0.19
120	601677	明泰铝业	16,900	280,540.00	0.19
121	300434	金石亚药	24,900	279,627.00	0.19
122	300513	恒实科技	38,500	278,740.00	0.19

123	603198	迎驾贡酒	9,400	278,240.00	0.19
124	603383	顶点软件	10,400	276,224.00	0.18
125	002466	天齐锂业	4,500	275,940.00	0.18
126	601665	齐鲁银行	47,500	274,075.00	0.18
127	300769	德方纳米	4,100	272,650.00	0.18
128	600908	无锡银行	53,500	271,780.00	0.18
129	600926	杭州银行	18,600	268,770.00	0.18
130	002379	宏桥控股	18,000	265,860.00	0.18
131	000709	河钢股份	136,700	265,198.00	0.18
132	002842	翔鹭钨业	5,500	265,100.00	0.18
133	000807	云铝股份	11,900	263,466.00	0.18
134	002136	安纳达	20,000	261,600.00	0.17
135	002653	海思科	3,800	252,092.00	0.17
136	300972	万辰集团	1,400	242,774.00	0.16
137	000014	沙河股份	26,300	240,119.00	0.16
138	300475	香农芯创	800	240,000.00	0.16
139	300562	乐心医疗	17,600	237,776.00	0.16
140	000623	吉林敖东	13,400	237,582.00	0.16
141	688165	埃夫特	11,580	236,232.00	0.16
142	002876	三利谱	6,600	232,386.00	0.15
143	300689	澄天伟业	3,300	231,594.00	0.15
144	601121	宝地矿业	40,400	227,856.00	0.15
145	002310	东方新能	93,400	223,226.00	0.15
146	002761	浙江建投	33,600	222,768.00	0.15
147	688448	磁谷科技	3,458	219,790.48	0.15
148	600288	大恒科技	16,500	219,450.00	0.15
149	603903	中持股份	16,200	218,538.00	0.15
150	601869	长飞光纤	400	218,360.00	0.15
151	603270	金帝股份	6,500	217,815.00	0.14
152	301093	华兰股份	1,600	217,008.00	0.14
153	002727	一心堂	22,600	216,734.00	0.14
154	688353	华盛锂电	1,852	214,961.64	0.14
155	002858	力盛体育	19,600	213,836.00	0.14
156	600481	双良节能	42,700	213,073.00	0.14
157	601360	三六零	24,500	212,905.00	0.14
158	688223	晶科能源	44,056	209,266.00	0.14
159	600503	华丽家族	105,100	209,149.00	0.14
160	600712	南宁百货	45,300	208,380.00	0.14
161	600569	安阳钢铁	125,500	208,330.00	0.14
162	600172	黄河旋风	12,400	208,320.00	0.14
163	301292	海科新源	2,600	207,298.00	0.14
164	600858	银座股份	46,900	206,829.00	0.14
165	600429	三元股份	50,800	205,232.00	0.14

166	002470	金正大	101,500	205,030.00	0.14
167	603194	中力股份	5,600	204,736.00	0.14
168	603613	国联股份	11,100	204,462.00	0.14
169	600881	亚泰集团	135,300	204,303.00	0.14
170	300721	怡达股份	5,400	203,310.00	0.14
171	002314	南山控股	101,500	203,000.00	0.13
172	300440	运达科技	9,500	202,635.00	0.13
173	000695	滨海能源	16,200	202,500.00	0.13
174	002321	华英农业	121,200	202,404.00	0.13
175	301013	利和兴	2,800	202,300.00	0.13
176	000069	华侨城 A	123,300	202,212.00	0.13
176	002086	东方海洋	123,300	202,212.00	0.13
178	000898	鞍钢股份	108,000	201,960.00	0.13
179	600827	百联股份	27,200	201,552.00	0.13
180	002607	中公教育	111,700	201,060.00	0.13
181	603057	紫燕食品	9,000	200,700.00	0.13
182	002286	保龄宝	24,200	199,650.00	0.13
183	000926	福星股份	104,100	198,831.00	0.13
184	002219	新里程	114,900	198,777.00	0.13
185	301349	信德新材	2,700	198,720.00	0.13
186	000718	苏宁环球	116,800	198,560.00	0.13
187	000701	厦门信达	44,600	197,578.00	0.13
188	300197	节能铁汉	102,000	194,820.00	0.13
189	300700	岱勒新材	9,100	193,648.00	0.13
190	002738	中矿资源	3,200	188,768.00	0.13
191	601226	华电科工	29,400	186,984.00	0.12
192	688235	百济神州	733	186,629.13	0.12
193	300142	沃森生物	14,300	185,757.00	0.12
194	688349	三一重能	11,948	181,370.64	0.12
195	002812	恩捷股份	2,700	180,657.00	0.12
196	688599	天合光能	12,585	177,700.20	0.12
197	600884	杉杉股份	13,100	177,505.00	0.12
198	000576	甘化科工	26,900	176,733.00	0.12
199	002517	恺英网络	10,800	175,500.00	0.12
200	000539	粤电力 A	25,700	175,017.00	0.12
201	600332	白云山	8,700	174,348.00	0.12
202	603077	和邦生物	74,700	173,304.00	0.12
203	300604	长川科技	500	170,710.00	0.11
204	600816	建元信托	69,300	169,092.00	0.11
205	002966	苏州银行	23,500	163,560.00	0.11
206	600292	电投水电	13,400	161,336.00	0.11
207	300647	超频三	26,900	160,055.00	0.11
208	688331	荣昌生物	1,201	156,442.26	0.10

209	301043	绿岛风	3,100	152,241.00	0.10
210	000551	创元科技	7,300	150,599.00	0.10
211	002141	贤丰控股	28,600	150,436.00	0.10
212	300701	森霸传感	15,700	150,249.00	0.10
213	300030	阳普医疗	25,600	148,736.00	0.10
214	603271	永杰新材	3,300	146,685.00	0.10
215	000810	创维数字	11,000	145,750.00	0.10
216	002460	赣锋锂业	2,200	143,880.00	0.10
217	002833	弘亚数控	7,400	142,746.00	0.09
218	605028	世茂能源	6,700	142,710.00	0.09
219	603815	交建股份	27,400	142,480.00	0.09
220	000519	中兵红箭	6,600	139,062.00	0.09
221	002078	太阳纸业	11,100	138,639.00	0.09
222	603588	高能环境	7,200	138,240.00	0.09
223	300206	理邦仪器	11,300	138,199.00	0.09
224	300298	三诺生物	9,900	138,105.00	0.09
225	300459	汤姆猫	40,600	137,634.00	0.09
226	600323	瀚蓝环境	5,000	137,300.00	0.09
227	000800	一汽解放	22,964	136,635.80	0.09
228	000951	中国重汽	7,000	136,570.00	0.09
229	002996	顺博合金	23,100	136,290.00	0.09
230	600626	申达股份	42,700	136,213.00	0.09
231	301608	博实结	2,700	135,702.00	0.09
232	301260	格力博	10,000	135,100.00	0.09
233	300226	上海钢联	8,820	135,034.20	0.09
234	600218	全柴动力	18,700	135,014.00	0.09
235	002299	圣农发展	8,900	134,924.00	0.09
236	301613	新铝时代	3,700	134,791.00	0.09
237	002668	TCL 智家	12,100	134,068.00	0.09
238	600426	华鲁恒升	5,600	133,952.00	0.09
239	600522	中天科技	2,200	133,496.00	0.09
240	000690	宝新能源	28,400	133,480.00	0.09
241	300244	迪安诊断	7,100	133,054.00	0.09
242	301136	招标股份	12,000	131,760.00	0.09
243	002936	郑州银行	79,500	131,175.00	0.09
244	001227	兰州银行	65,400	130,800.00	0.09
245	002795	永和智控	19,500	130,455.00	0.09
246	002259	升达林业	34,300	129,997.00	0.09
247	300854	中兰环保	6,800	129,744.00	0.09
248	000402	金 融 街	52,400	126,284.00	0.08
249	301666	大普微	262	121,392.46	0.08
250	603045	福达合金	1,700	121,363.00	0.08
251	300452	山河药辅	9,900	115,632.00	0.08

252	002476	新叶股份	23,300	113,238.00	0.08
253	002995	天地在线	6,300	111,384.00	0.07
254	002388	新亚制程	20,900	109,516.00	0.07
255	300509	新美星	13,000	108,940.00	0.07
256	301159	三维天地	3,700	107,670.00	0.07
257	603017	中衡设计	10,800	107,460.00	0.07
258	301505	苏州规划	6,600	106,260.00	0.07
259	000565	渝三峡 A	18,700	106,216.00	0.07
260	000573	粤宏远 A	29,700	105,138.00	0.07
261	002576	通达动力	7,300	103,295.00	0.07
262	002652	扬子新材	24,000	102,240.00	0.07
263	688503	聚和材料	722	95,809.40	0.06
264	301208	中亦科技	3,300	94,017.00	0.06
265	002722	物产金轮	7,200	84,888.00	0.06
266	300987	川网传媒	6,800	83,640.00	0.06
267	300540	蜀道装备	2,200	83,380.00	0.06
268	001248	华润新能源	8,242	83,326.62	0.06
269	300975	商络电子	1,600	82,800.00	0.06
270	002972	科安达	4,200	82,152.00	0.05
271	300373	扬杰科技	500	78,615.00	0.05
272	688275	万润新能	601	76,657.55	0.05
273	000938	紫光股份	2,600	75,036.00	0.05
274	600552	凯盛科技	2,300	74,934.00	0.05
275	603124	江南新材	400	74,792.00	0.05
276	300242	佳云科技	15,900	74,730.00	0.05
277	300357	我武生物	3,200	74,624.00	0.05
278	603031	安孚科技	1,400	74,550.00	0.05
279	002437	誉衡药业	27,500	74,250.00	0.05
280	300673	佩蒂股份	5,500	73,975.00	0.05
281	002484	江海股份	700	73,500.00	0.05
282	002568	百润股份	4,300	72,756.00	0.05
283	688239	航宇科技	1,214	72,633.62	0.05
284	603228	景旺电子	1,000	72,410.00	0.05
285	000100	TCL 科技	12,400	72,168.00	0.05
286	688231	隆达股份	1,964	72,137.72	0.05
287	301380	挖金客	2,600	71,734.00	0.05
288	603444	吉比特	200	71,684.00	0.05
289	300602	飞荣达	1,400	71,680.00	0.05
290	000921	海信家电	2,600	71,032.00	0.05
291	601038	一拖股份	6,700	70,953.00	0.05
292	603025	大豪科技	5,200	70,928.00	0.05
293	600315	上海家化	4,200	70,644.00	0.05
294	002345	潮宏基	7,700	70,609.00	0.05

295	000776	广发证券	3,000	70,200.00	0.05
296	603421	鼎信通讯	11,400	70,110.00	0.05
297	300473	德尔股份	2,300	69,920.00	0.05
298	603197	保隆科技	2,500	69,850.00	0.05
299	002555	三七互娱	3,700	69,819.00	0.05
300	000629	钒钛股份	20,900	69,806.00	0.05
301	600380	健康元	7,400	69,708.00	0.05
302	300850	新强联	2,600	69,680.00	0.05
303	002283	天润工业	7,200	69,480.00	0.05
304	300957	贝泰妮	2,200	69,322.00	0.05
305	600203	福日电子	5,700	69,255.00	0.05
306	300912	凯龙高科	2,900	69,020.00	0.05
307	688249	晶合集成	1,167	68,888.01	0.05
308	300168	万达信息	15,000	68,850.00	0.05
309	600361	创新新材	19,100	68,760.00	0.05
310	600739	辽宁成大	6,800	68,748.00	0.05
311	300132	青松股份	12,100	68,728.00	0.05
312	300453	三鑫医疗	7,600	68,704.00	0.05
313	300492	华图山鼎	2,000	68,700.00	0.05
314	601006	大秦铁路	14,900	68,689.00	0.05
315	603708	家家悦	8,000	68,640.00	0.05
316	000049	德赛电池	2,936	68,614.32	0.05
317	603669	灵康药业	12,100	68,607.00	0.05
318	300299	富春股份	14,000	68,600.00	0.05
319	002092	中泰化学	17,900	68,557.00	0.05
320	000526	学大教育	2,700	68,526.00	0.05
321	605599	莱百股份	5,000	68,500.00	0.05
322	603030	全筑股份	34,400	68,456.00	0.05
323	300184	力源信息	3,900	68,445.00	0.05
324	002444	巨星科技	2,200	68,420.00	0.05
325	002415	海康威视	2,000	68,400.00	0.05
325	600185	珠免集团	15,200	68,400.00	0.05
327	002296	辉煌科技	7,700	68,376.00	0.05
328	002919	名臣健康	3,600	68,364.00	0.05
329	600754	锦江酒店	3,800	68,362.00	0.05
330	601618	中国中冶	28,000	68,320.00	0.05
331	002107	沃华医药	12,000	68,280.00	0.05
332	300233	金城医药	5,500	68,200.00	0.05
332	600210	紫江企业	11,000	68,200.00	0.05
334	000950	重药控股	13,600	68,136.00	0.05
335	600929	雪天盐业	15,000	68,100.00	0.05
336	600713	南京医药	13,600	68,000.00	0.05
337	300783	三只松鼠	4,300	67,940.00	0.05

338	300012	华测检测	4,900	67,914.00	0.05
339	002609	捷顺科技	8,900	67,818.00	0.05
340	600798	宁波海运	21,800	67,798.00	0.05
341	300529	健帆生物	4,400	67,760.00	0.05
342	301500	飞南资源	2,600	67,730.00	0.05
343	300786	国林科技	2,700	67,689.00	0.05
344	002244	滨江集团	8,900	67,640.00	0.04
345	300099	尤洛卡	10,700	67,624.00	0.04
346	002787	华源控股	2,100	67,620.00	0.04
347	002946	新乳业	4,800	67,584.00	0.04
348	002616	长青集团	15,100	67,497.00	0.04
349	002390	信邦制药	25,800	67,338.00	0.04
350	300532	今天国际	10,800	67,284.00	0.04
351	300761	立华股份	4,100	67,281.00	0.04
352	000783	长江证券	6,900	67,275.00	0.04
352	603162	海通发展	7,500	67,275.00	0.04
354	603049	中策橡胶	1,500	67,215.00	0.04
355	002933	新兴装备	2,600	67,210.00	0.04
356	300988	津荣天宇	4,300	67,209.00	0.04
357	002090	金智科技	7,600	67,184.00	0.04
358	600221	海航控股	49,700	67,095.00	0.04
359	300771	智莱科技	6,500	67,080.00	0.04
360	605305	中际联合	1,600	67,072.00	0.04
361	002900	哈三联	7,300	67,014.00	0.04
362	300092	科新机电	5,800	66,932.00	0.04
363	002033	丽江股份	8,100	66,906.00	0.04
363	300172	中电环保	16,200	66,906.00	0.04
365	002701	奥瑞金	15,700	66,882.00	0.04
366	300953	震裕科技	500	66,850.00	0.04
367	301010	晶雪节能	4,100	66,789.00	0.04
368	002162	悦心健康	19,700	66,586.00	0.04
369	000550	江铃汽车	4,100	66,502.00	0.04
370	002029	七匹狼	8,700	66,468.00	0.04
371	002513	蓝丰生化	13,900	66,442.00	0.04
372	001215	千味央厨	1,800	66,420.00	0.04
373	300691	联合光电	4,200	66,402.00	0.04
374	002489	浙江永强	24,500	66,395.00	0.04
375	000966	长源电力	16,900	66,248.00	0.04
376	600498	烽火通信	900	66,240.00	0.04
376	603042	华脉科技	4,600	66,240.00	0.04
378	300662	科锐国际	3,900	66,222.00	0.04
379	002401	中远海科	5,700	66,177.00	0.04
380	301507	民生健康	5,500	66,165.00	0.04

381	000812	陕西金叶	21,300	66,030.00	0.04
382	300146	汤臣倍健	7,300	65,992.00	0.04
383	002454	松芝股份	13,800	65,964.00	0.04
384	601111	中国国航	10,900	65,945.00	0.04
385	002772	众兴菌业	5,800	65,888.00	0.04
386	002215	诺普信	8,000	65,840.00	0.04
387	002443	金洲管道	6,900	65,757.00	0.04
388	000899	赣能股份	6,800	65,688.00	0.04
389	003029	吉大正元	4,100	65,682.00	0.04
390	000612	焦作万方	6,200	65,658.00	0.04
391	003042	中农联合	5,400	65,610.00	0.04
392	600176	中国巨石	900	65,592.00	0.04
393	002441	众业达	8,400	65,520.00	0.04
393	002839	张家港行	16,800	65,520.00	0.04
395	000514	渝开发	18,300	65,514.00	0.04
396	300559	佳发教育	6,400	65,472.00	0.04
397	002462	嘉事堂	6,100	65,453.00	0.04
397	002532	天山铝业	6,100	65,453.00	0.04
399	002458	益生股份	8,420	65,423.40	0.04
400	000001	平安银行	6,500	65,325.00	0.04
401	301278	快可电子	2,300	65,320.00	0.04
402	002142	宁波银行	2,200	65,318.00	0.04
403	002596	海南瑞泽	22,800	65,208.00	0.04
404	603400	华之杰	1,200	64,824.00	0.04
405	301109	军信股份	5,200	64,792.00	0.04
406	600115	中国东航	17,000	64,770.00	0.04
407	603092	德力佳	1,200	64,764.00	0.04
408	300643	万通智控	3,600	64,404.00	0.04
409	603527	众源新材	5,400	64,368.00	0.04
410	603489	八方股份	2,300	64,308.00	0.04
411	002752	昇兴股份	11,600	64,032.00	0.04
412	301051	信濠光电	3,300	64,020.00	0.04
413	002254	泰和新材	3,500	63,665.00	0.04
414	300599	雄塑科技	6,300	63,441.00	0.04
415	002080	中材科技	700	63,000.00	0.04
416	600026	中远海能	3,500	62,790.00	0.04
417	301053	远信工业	1,700	62,730.00	0.04
418	600596	新安股份	3,900	62,244.00	0.04
419	601975	招商南油	16,600	61,918.00	0.04
420	600961	株冶集团	1,900	61,541.00	0.04
421	002928	华夏航空	8,800	61,512.00	0.04
422	601872	招商轮船	3,500	61,495.00	0.04
423	000333	美的集团	800	60,424.00	0.04

424	002008	大族激光	400	60,044.00	0.04
425	002628	成都路桥	11,200	59,920.00	0.04
426	603500	祥和实业	4,800	55,776.00	0.04
427	688279	峰岷科技	248	55,661.12	0.04
428	301428	世纪恒通	1,600	55,312.00	0.04
429	603949	雪龙集团	3,000	52,560.00	0.03
430	002849	威星智能	3,000	50,760.00	0.03
431	600768	宁波富邦	3,100	46,438.00	0.03
432	300810	中科海讯	1,800	45,684.00	0.03
433	000965	天保基建	15,500	45,260.00	0.03
434	300694	蠡湖股份	4,700	45,120.00	0.03
435	603059	倍加洁	1,800	43,650.00	0.03
436	600327	大东方	14,000	43,400.00	0.03
437	002391	长青股份	8,900	43,343.00	0.03
438	300664	鹏鹞环保	10,100	42,824.00	0.03
439	301152	天力锂能	1,800	42,606.00	0.03
440	300591	万里马	6,300	42,399.00	0.03
441	300824	北鼎股份	5,900	42,362.00	0.03
442	300743	天地数码	2,900	42,311.00	0.03
443	002398	垒知集团	11,200	42,000.00	0.03
444	300087	ST 荃银	7,800	41,964.00	0.03
445	002593	日上集团	10,500	41,895.00	0.03
446	600738	丽尚国潮	11,600	41,760.00	0.03
447	600128	苏豪弘业	5,500	41,745.00	0.03
448	603900	莱绅通灵	7,400	41,662.00	0.03
449	002574	明牌珠宝	9,900	41,085.00	0.03
450	002679	福建金森	5,200	40,976.00	0.03
451	003003	天元股份	4,100	40,795.00	0.03
452	600356	恒丰纸业	5,500	40,755.00	0.03
453	600706	曲江文旅	6,000	40,380.00	0.03
454	300275	梅安森	5,000	40,150.00	0.03
455	300753	爱朋医疗	2,100	39,753.00	0.03
456	301299	卓创资讯	900	39,654.00	0.03
457	301388	欣灵电气	1,700	39,644.00	0.03
458	300515	三德科技	3,000	39,150.00	0.03
459	301567	贝隆精密	1,100	38,071.00	0.03
460	300651	金陵体育	2,000	35,700.00	0.02
461	688797	臻宝科技	64	29,994.88	0.02
462	688635	长进光子	88	27,120.72	0.02
463	301682	宏明电子	149	23,848.94	0.02
464	001399	惠科股份	844	23,404.12	0.02
465	001257	盛龙股份	659	13,667.66	0.01
466	301531	春光集团	237	12,219.72	0.01

467	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.01
468	301669	高特电子	354	10,053.60	0.01
469	301696	三瑞智能	101	8,766.80	0.01
470	301599	理奇智能	268	8,701.96	0.01
471	300857	协创数据	20	6,798.00	0.00
472	001365	天海电子	216	6,762.96	0.00
473	301513	尚水智能	119	6,064.24	0.00
474	001393	维通利	152	5,926.48	0.00
475	001237	惠康科技	91	5,345.34	0.00
476	603435	嘉德利	100	4,671.00	0.00
477	688615	合合信息	40	4,524.00	0.00
478	688458	美芯晟	100	4,176.00	0.00
479	002768	国恩股份	80	4,164.80	0.00
480	301680	固德电材	35	3,925.60	0.00
481	301662	宏工科技	35	3,546.20	0.00
482	301338	凯格精机	20	3,257.80	0.00
483	688302	海创药业	55	1,934.35	0.00
484	688133	泰坦科技	85	1,796.05	0.00
485	603293	埃泰克	33	1,119.69	0.00
486	688388	嘉元科技	20	880.00	0.00
487	603313	梦百合	50	296.00	0.00
488	000922	佳电股份	20	279.20	0.00
489	301082	久盛电气	20	179.20	0.00
490	600694	大商股份	10	132.30	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	300511	雪榕生物	7,335,865.02	5.95
2	600166	福田汽车	6,878,694.00	5.58
3	603939	益丰药房	6,849,343.00	5.55
4	000421	南京公用	6,717,898.00	5.45
5	300106	西部牧业	6,676,378.00	5.41
6	300226	上海钢联	6,083,231.00	4.93
7	000589	贵州轮胎	5,756,408.00	4.67
8	600872	中炬高新	5,710,551.00	4.63
9	300169	天晟新材	5,620,656.00	4.56
10	603233	大参林	5,443,850.00	4.41
11	002847	盐津铺子	5,413,245.60	4.39
12	600540	新赛股份	5,303,097.00	4.30
13	002132	恒星科技	5,246,867.00	4.25
14	603317	天味食品	4,959,606.00	4.02
15	300971	博亚精工	4,823,552.00	3.91

16	603903	中持股份	4,736,743.00	3.84
17	002313	日海智能	4,693,880.00	3.81
18	300556	丝路视觉	4,656,058.00	3.78
19	300662	科锐国际	4,615,160.57	3.74
20	002715	登云股份	4,550,587.00	3.69
21	600267	海正药业	4,543,777.00	3.68
22	600257	大湖股份	4,491,627.00	3.64
23	603185	弘元绿能	4,484,283.00	3.64
24	000567	海德股份	4,455,790.00	3.61
25	002154	报喜鸟	4,428,726.00	3.59
26	002283	天润工业	4,363,760.00	3.54
27	600361	创新新材	4,356,680.00	3.53
28	301118	恒光股份	4,309,874.00	3.50
29	600754	锦江酒店	4,294,014.00	3.48
30	601233	桐昆股份	4,292,771.30	3.48
31	300358	楚天科技	4,254,002.00	3.45
32	600335	国机汽车	4,218,432.00	3.42
33	300094	国联水产	4,172,111.00	3.38
34	603816	顾家家居	4,130,451.80	3.35
35	000703	恒逸石化	4,032,413.46	3.27
36	600717	天津港	4,025,641.00	3.26
37	603305	旭升集团	4,015,919.00	3.26
38	688111	金山办公	4,003,552.31	3.25
39	002832	比音勒芬	3,998,870.00	3.24
40	601997	贵阳银行	3,867,832.00	3.14
41	603035	常熟汽饰	3,782,344.00	3.07
42	300030	阳普医疗	3,750,816.00	3.04
43	002054	德美化工	3,690,384.00	2.99
44	603345	安井食品	3,658,674.00	2.97
45	300254	仟源医药	3,644,271.40	2.96
46	300861	美畅股份	3,642,040.00	2.95
47	002696	百洋股份	3,641,832.00	2.95
48	600936	北投科技	3,630,955.00	2.94
49	300500	启迪设计	3,599,275.00	2.92
50	301027	华蓝集团	3,585,107.00	2.91
51	603399	永杉锂业	3,563,487.00	2.89
52	300854	中兰环保	3,552,303.08	2.88
53	002574	明牌珠宝	3,548,330.80	2.88
54	600185	珠免集团	3,519,462.00	2.85
55	300562	乐心医疗	3,502,764.00	2.84
56	600203	福日电子	3,475,603.00	2.82
57	002826	易明医药	3,463,963.00	2.81
58	002415	海康威视	3,433,160.00	2.78

59	002120	韵达股份	3,401,418.00	2.76
60	603045	福达合金	3,384,598.00	2.74
61	301500	飞南资源	3,355,914.00	2.72
62	600626	申达股份	3,302,076.00	2.68
63	002266	浙富控股	3,284,879.00	2.66
64	000059	华锦股份	3,276,643.00	2.66
65	601007	金陵饭店	3,260,606.00	2.64
66	600582	天地科技	3,245,888.00	2.63
67	000049	德赛电池	3,203,931.72	2.60
68	002458	益生股份	3,191,038.00	2.59
69	600266	城建发展	3,161,825.00	2.56
70	002629	仁智股份	3,148,940.00	2.55
71	002831	裕同科技	3,138,284.00	2.54
72	300069	金利华电	3,108,412.00	2.52
73	601860	紫金银行	3,100,706.00	2.51
74	301260	格力博	3,028,721.00	2.46
75	600933	爱柯迪	3,014,844.00	2.44
76	001965	招商公路	2,988,065.00	2.42
77	603876	鼎胜新材	2,962,672.00	2.40
78	300464	星徽股份	2,933,700.00	2.38
79	002060	广东建工	2,929,203.00	2.38
80	603313	梦百合	2,927,524.59	2.37
81	001914	招商积余	2,922,129.06	2.37
82	603997	继峰股份	2,914,475.00	2.36
83	301321	翰博高新	2,913,554.00	2.36
84	301607	富特科技	2,907,824.26	2.36
85	300707	威唐工业	2,906,689.00	2.36
86	300605	恒锋信息	2,892,693.00	2.35
87	000563	陕国投 A	2,889,610.00	2.34
88	002976	瑞玛精密	2,880,475.00	2.34
89	600038	中直股份	2,878,248.00	2.33
90	002493	荣盛石化	2,870,899.00	2.33
91	300644	南京聚隆	2,865,592.00	2.32
92	600029	南方航空	2,851,595.00	2.31
93	300970	华绿生物	2,837,873.00	2.30
94	600115	中国东航	2,829,285.00	2.29
95	002271	东方雨虹	2,826,835.00	2.29
96	002345	潮宏基	2,798,744.00	2.27
97	002958	青农商行	2,797,618.00	2.27
98	600704	物产中大	2,784,889.00	2.26
99	601333	广深铁路	2,783,578.00	2.26
100	300746	汉嘉数智	2,769,044.00	2.25
101	301511	德福科技	2,768,574.00	2.25

102	603100	川仪股份	2,765,835.00	2.24
103	301555	惠柏新材	2,739,833.00	2.22
104	300438	鹏辉能源	2,736,002.00	2.22
105	300452	山河药辅	2,730,659.00	2.21
106	002107	沃华医药	2,729,583.00	2.21
107	688021	奥福科技	2,728,393.26	2.21
108	603817	海峡环保	2,718,076.00	2.20
109	300575	中旗股份	2,713,790.50	2.20
110	605020	永和股份	2,704,456.00	2.19
111	603018	华设集团	2,698,785.00	2.19
112	605208	永茂泰	2,677,244.00	2.17
113	300357	我武生物	2,665,413.00	2.16
114	688023	安恒信息	2,663,926.68	2.16
115	600684	珠江股份	2,661,600.00	2.16
116	300206	理邦仪器	2,660,663.00	2.16
117	300791	仙乐健康	2,649,407.48	2.15
118	600572	康恩贝	2,637,758.00	2.14
119	600989	宝丰能源	2,636,156.00	2.14
120	000778	新兴铸管	2,607,434.00	2.11
121	603737	三棵树	2,604,108.60	2.11
122	601865	福莱特	2,602,180.00	2.11
123	002841	视源股份	2,597,828.00	2.11
124	600011	华能国际	2,594,189.00	2.10
125	600116	三峡水利	2,585,550.00	2.10
126	002839	张家港行	2,576,579.00	2.09
127	300219	鸿利智汇	2,576,268.00	2.09
128	603588	高能环境	2,566,468.60	2.08
129	600382	广东明珠	2,540,388.00	2.06
130	002398	垒知集团	2,528,592.00	2.05
131	603335	迪生力	2,518,346.00	2.04
132	300596	利安隆	2,502,340.00	2.03
133	002319	乐通股份	2,490,506.00	2.02
134	002593	日上集团	2,469,233.00	2.00

注：买入金额不包括相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600166	福田汽车	8,398,434.00	6.81
2	603045	福达合金	6,493,444.00	5.27
3	603939	益丰药房	6,412,542.00	5.20
4	301027	华蓝集团	6,299,971.00	5.11
5	000421	南京公用	6,038,823.00	4.90
6	300106	西部牧业	5,903,262.00	4.79

7	300511	雪榕生物	5,636,393.00	4.57
8	600361	创新新材	5,570,170.00	4.52
9	300226	上海钢联	5,569,950.00	4.52
10	300069	金利华电	5,360,998.00	4.35
11	002847	盐津铺子	5,230,959.00	4.24
12	300030	阳普医疗	5,183,760.00	4.20
13	002831	裕同科技	5,171,494.89	4.19
14	601997	贵阳银行	4,951,654.00	4.02
15	002132	恒星科技	4,820,389.00	3.91
16	603335	迪生力	4,792,829.00	3.89
17	300596	利安隆	4,708,352.00	3.82
18	600011	华能国际	4,561,252.00	3.70
19	603185	弘元绿能	4,548,545.00	3.69
20	301555	惠柏新材	4,512,835.00	3.66
21	600626	申达股份	4,488,784.00	3.64
22	600257	大湖股份	4,435,791.00	3.60
23	300662	科锐国际	4,432,272.00	3.59
24	603903	中持股份	4,428,057.00	3.59
25	603816	顾家家居	4,420,053.00	3.58
26	300464	星徽股份	4,390,435.00	3.56
27	600754	锦江酒店	4,331,076.00	3.51
28	300254	仟源医药	4,293,034.00	3.48
29	603305	旭升集团	4,203,314.00	3.41
30	000567	海德股份	4,178,851.00	3.39
31	600116	三峡水利	4,151,570.00	3.37
32	000589	贵州轮胎	4,145,678.00	3.36
33	603317	天味食品	4,123,226.40	3.34
34	603233	大参林	4,122,307.28	3.34
35	600335	国机汽车	3,950,846.00	3.20
36	002832	比音勒芬	3,929,453.00	3.19
37	002283	天润工业	3,924,585.00	3.18
38	603035	常熟汽饰	3,909,865.00	3.17
39	300861	美畅股份	3,903,048.92	3.17
40	301321	翰博高新	3,821,696.00	3.10
41	600936	北投科技	3,811,119.00	3.09
42	600717	天津港	3,749,158.32	3.04
43	600203	福日电子	3,711,485.00	3.01
44	002826	易明医药	3,650,300.00	2.96
45	000049	德赛电池	3,617,777.47	2.93
46	600027	华电国际	3,616,013.00	2.93
47	002415	海康威视	3,562,078.00	2.89
48	600739	辽宁成大	3,545,429.00	2.88
49	603876	鼎胜新材	3,522,351.44	2.86

50	603737	三棵树	3,511,909.00	2.85
51	000422	湖北宜化	3,508,401.00	2.85
52	300854	中兰环保	3,472,377.60	2.82
53	300169	天晟新材	3,470,678.00	2.81
54	002244	滨江集团	3,437,871.00	2.79
55	000778	新兴铸管	3,431,459.00	2.78
56	603399	永杉锂业	3,430,722.00	2.78
57	300500	启迪设计	3,413,091.00	2.77
58	002696	百洋股份	3,406,088.00	2.76
59	600989	宝丰能源	3,405,096.77	2.76
60	600686	金龙汽车	3,402,298.00	2.76
61	300971	博亚精工	3,360,843.00	2.73
62	600872	中炬高新	3,352,844.00	2.72
63	600185	珠免集团	3,320,934.00	2.69
64	300707	威唐工业	3,281,773.00	2.66
65	301118	恒光股份	3,280,474.00	2.66
66	002574	明牌珠宝	3,240,470.80	2.63
67	002154	报喜鸟	3,240,011.00	2.63
68	002746	仙坛股份	3,238,116.11	2.63
69	300438	鹏辉能源	3,205,213.00	2.60
70	002976	瑞玛精密	3,194,831.00	2.59
71	002060	广东建工	3,192,352.00	2.59
72	300407	凯发电气	3,192,123.00	2.59
73	300746	汉嘉数智	3,183,297.00	2.58
74	605208	永茂泰	3,183,149.98	2.58
75	002313	日海智能	3,164,160.00	2.57
76	001914	招商积余	3,163,465.00	2.57
77	601007	金陵饭店	3,158,550.00	2.56
78	603313	梦百合	3,151,139.51	2.56
79	002054	德美化工	3,150,831.00	2.56
80	688111	金山办公	3,141,437.22	2.55
81	002266	浙富控股	3,140,580.00	2.55
82	301607	富特科技	3,124,438.00	2.53
83	605020	永和股份	3,119,312.00	2.53
84	600582	天地科技	3,104,144.00	2.52
85	002629	仁智股份	3,100,506.00	2.51
86	600572	康恩贝	3,099,673.00	2.51
87	002458	益生股份	3,092,902.80	2.51
88	002120	韵达股份	3,063,709.00	2.48
89	002107	沃华医药	3,054,296.00	2.48
90	300358	楚天科技	3,052,916.00	2.48
91	301260	格力博	3,040,186.65	2.47
92	301511	德福科技	3,010,196.00	2.44

93	601233	桐昆股份	2,990,404.00	2.43
94	601860	紫金银行	2,937,064.00	2.38
95	002715	登云股份	2,934,523.00	2.38
96	301500	飞南资源	2,924,884.00	2.37
97	001965	招商公路	2,923,461.00	2.37
98	300219	鸿利智汇	2,920,338.00	2.37
99	300562	乐心医疗	2,856,117.00	2.32
100	002958	青农商行	2,851,882.00	2.31
101	002345	潮宏基	2,844,957.00	2.31
102	603018	华设集团	2,824,656.00	2.29
103	000059	华锦股份	2,808,994.00	2.28
104	600267	海正药业	2,787,715.00	2.26
105	603588	高能环境	2,784,643.00	2.26
106	000563	陕国投 A	2,763,691.00	2.24
107	601865	福莱特	2,751,888.00	2.23
108	300556	丝路视觉	2,742,557.00	2.22
109	600933	爱柯迪	2,733,219.00	2.22
110	002897	意华股份	2,729,353.00	2.21
111	002918	蒙娜丽莎	2,721,164.00	2.21
112	300206	理邦仪器	2,714,240.00	2.20
113	002839	张家港行	2,704,122.00	2.19
114	002271	东方雨虹	2,690,399.00	2.18
115	600704	物产中大	2,687,595.00	2.18
116	600038	中直股份	2,679,651.00	2.17
117	600684	珠江股份	2,644,364.00	2.14
118	688023	安恒信息	2,629,736.77	2.13
119	300644	南京聚隆	2,614,327.00	2.12
120	300357	我武生物	2,612,953.00	2.12
121	000703	恒逸石化	2,598,340.00	2.11
122	300452	山河药辅	2,570,619.00	2.08
123	600057	厦门象屿	2,568,769.00	2.08
124	603997	继峰股份	2,559,035.00	2.08
125	300605	恒锋信息	2,545,678.00	2.06
126	600115	中国东航	2,541,378.00	2.06
127	600382	广东明珠	2,523,716.00	2.05

注：卖出金额不包括相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	969,403,805.77
卖出股票收入（成交）总额	939,448,825.28

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

华宝量化选股混合发起式截止 2026 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,浙江海正药业股份有限公司因信息披露虚假或严重误导性陈述;于 2026 年 01 月 16 日收到上海证券交易所通报批评,记入诚信档案的处罚措施。

华宝量化选股混合发起式截止 2026 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,浙江海正药业股份有限公司因信息披露虚假或严重误导性陈述;于 2026 年 01 月 16 日收到中国证券监督管理委员会浙江监管局警示,记入诚信档案的处罚措施。

华宝量化选股混合发起式截止 2026 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,新疆赛里木现代农业股份有限公司因信息披露违规;于 2026 年 06 月 23 日收到中国证券监督管理委员会立案调查的处罚措施。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和他析,认为上述处分不会对公司的投资价值构成实质性影响,因此本基金管理人对上述证券的投资判断未发生改变。报告期内,本基金

投资的前十名证券的其余的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 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	47,304.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	47,304.06

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，合计数可能不等于分项之和。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
华宝量化选股混合发起式 A	6,283	4,162.29	11,881,353.54	45.43	14,270,294.19	54.57
华宝量化	676	119,172.71	71,418,341.12	88.65	9,142,407.86	11.35

选股混合发起式 C						
合计	6,959	15,334.44	83,299,694.66	78.06	23,412,702.05	21.94

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（%）	25.12

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	华宝量化选股混合发起式 A	1,826,723.26	6.9851
	华宝量化选股混合发起式 C	204,252.02	0.2535
	合计	2,030,975.28	1.9032

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	华宝量化选股混合发起式 A	10~50
	华宝量化选股混合发起式 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	华宝量化选股混合发起式 A	>100
	华宝量化选股混合发起式 C	10~50
	合计	>100

8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

无

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华宝量化选股混合发起式 A	华宝量化选股混合发起式 C
基金合同生效日（2023 年 2 月 20 日）基金份额总额	19,742,180.45	74,223,121.88
本报告期期初基金份额总额	18,361,315.86	69,850,922.95

本报告期基金总申购份额	33,360,164.65	174,634,974.28
减：本报告期基金总赎回份额	25,569,832.78	163,925,148.25
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	26,151,647.73	80,560,748.98

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、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

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产和基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：2025 年 11 月 11 日起至本报告期末。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期，基金托管人未受到调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期，基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
东吴证券	2	1,592,438,282.29	83.45	541,837.17	83.22	-
粤开证券	2	315,897,071.09	16.55	109,272.13	16.78	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：1. 基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

（1）选择标准: 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需 要，并能为本基金提供全面的信息服 务；研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人 员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；适当的地域分散化。

（2）选择程序: 根据证监会《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》和公司《公募基金及私募资产管理计划专用交易席位管理办法》的要求，公司与符合前述标准的证券公司，签订《证券交易单元租用协议》，参与证券交易。

2. 本报告期证券公司交易单元新增的有：粤开证券。

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

本基金本报告期内未租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华宝量化选股混合型发起式证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2026-01-22
2	华宝基金关于旗下部分基金新增万和证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2026-01-23
3	华宝基金关于旗下部分基金新增东方证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2026-01-29

4	华宝基金关于旗下部分基金新增广发银行股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2026-03-16
5	华宝量化选股混合型发起式证券投资基金 2025 年年度报告	基金管理人网站	2026-03-31
6	华宝基金关于旗下部分基金新增上海证达通基金销售有限公司为代销机构的通知	基金管理人网站	2026-04-15
7	华宝基金关于华宝量化选股混合型发起式证券投资基金新增代销机构的公告	基金管理人网站, 中国证券报	2026-04-20
8	华宝量化选股混合型发起式证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2026-04-22
9	华宝基金关于旗下部分基金新增深圳前海微众银行股份有限公司为代销机构的通知	基金管理人网站	2026-04-24
10	华宝基金关于旗下部分基金新增北京济安基金销售有限公司为代销机构的通知	基金管理人网站	2026-05-20
11	华宝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	基金管理人网站, 中国证券报	2026-06-03
12	华宝基金关于旗下部分基金新增北京加和基金销售有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2026-06-05
13	华宝基金关于旗下部分基金新增上海国信嘉利基金销售有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2026-06-10
14	华宝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	基金管理人网站, 中国证券报	2026-06-17
15	华宝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	基金管理人网站, 中国证券报	2026-06-25

§ 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	20260515~20260518, 20260520~20260630	14, 295, 925. 66	33, 648, 243. 45	20, 856, 744. 45	27, 087, 424. 66	25. 38
产品特有风险							
报告期内本基金出现单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况。 在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下，如该投资者集中赎回，可能会增加基金的流动性风险。此外，由于基金在遇到大额赎回的时候可能需要变现部分资产，可能对持有资产的价格形成冲击，增加基金的市场风险。基金管理人将专业审慎、勤勉尽责地运作基金资产，加强防范流动性风险、市场风险，保护持有人利益。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 中国证监会批准基金设立的文件；
- 华宝量化选股混合型发起式证券投资基金基金合同；
- 华宝量化选股混合型发起式证券投资基金招募说明书；
- 华宝量化选股混合型发起式证券投资基金托管协议；
- 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；
- 基金托管人业务资格批件和营业执照。

12.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

12.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝基金管理有限公司
2026 年 8 月 31 日