贝莱德行业优选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：贝莱德基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 28 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 06 月 30 日止。

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 6
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遵规守信情况的说明 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 10
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 12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 13
§5 托管人报告 13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 13
§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 38
7.1 期末基金资产组合情况 38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 39
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 40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 43
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 43
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 43
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 44

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 44
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 44
7.12 投资组合报告附注 44
§8 基金份额持有人信息 45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 45
8.2 盈利投资者数量占比 45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 45
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 46
§9 开放式基金份额变动 46
§10 重大事件揭示 46
10.1 基金份额持有人大会决议 46
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 46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 47
10.4 基金投资策略的改变 47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 47
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 47
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 47
10.8 其他重大事件 48
§11 影响投资者决策的其他重要信息 49
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 49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 49
§12 备查文件目录 49
12.1 备查文件目录 49
12.2 存放地点 49
12.3 查阅方式 49

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	贝莱德行业优选混合型证券投资基金	
基金简称	贝莱德行业优选混合	
基金主代码	017400	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 3 月 28 日	
基金管理人	贝莱德基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	71,309,464.87 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	贝莱德行业优选混合 A	贝莱德行业优选混合 C
下属分级基金的交易代码	017400	017401
报告期末下属分级基金的份额总额	29,621,081.11 份	41,688,383.76 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，通过深入研究积极把握产业发展趋势，通过对产业和个股的精选，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	1、资产配置策略 本基金通过跟踪考量宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势、外汇占款等）及国家财政、货币等各项政策，判断经济周期及港股市场、A 股市场的相对估值和市场情况，动态调整各类资产的配置比例。 2、股票投资策略 本基金采用自上而下及自下而上相结合的筛选方法，辅以逆向投资的思维，甄选具备长期发展前景的产业，深入挖掘 A 股和港股通标的股票中的优质公司，构建本基金的股票投资组合。 3、债券投资策略 4、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债券投资策略 5、资产支持证券投资策略 6、金融衍生品投资策略 7、融资投资策略
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×75%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×15%+一年期定期存款利率(税后)×10%
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期风险和收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。本基金如果投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来

	的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		贝莱德基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	谢超	王小飞
	联系电话	021-80225188	021-60637103
	电子邮箱	Compliance_FMC@blackrock.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-002-6655	021-60637228
传真		021-80225288	021-60635778
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 7 楼 702 室	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 7 楼 702 室	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		郁蓓华	张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.blackrock.com.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国建设银行股份有限公司	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

§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)	
	贝莱德行业优选混合 A	贝莱德行业优选混合 C
本期已实现收益	741,439.54	928,117.65
本期利润	455,078.75	597,155.72
加权平均基金份额本期利润	0.0131	0.0128
本期加权平均净值利润率	1.35%	1.33%

本期基金份额净值增长率	0.82%	0.57%
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	-591,715.98	-1,492,800.07
期末可供分配基金份额利润	-0.0200	-0.0358
期末基金资产净值	29,029,365.13	40,195,583.69
期末基金份额净值	0.9800	0.9642
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	-2.00%	-3.58%

注：1、上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，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

贝莱德行业优选混合 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	7.64%	1.40%	7.41%	1.05%	0.23%	0.35%
过去六个月	0.82%	1.25%	3.35%	0.98%	-2.53%	0.27%
过去一年	12.64%	1.09%	18.26%	0.88%	-5.62%	0.21%
过去三年	0.46%	1.18%	25.41%	0.98%	-24.95%	0.20%
自基金合同生效	-2.00%	1.14%	21.70%	0.96%	-	0.18%

日起至今					23.70%	

贝莱德行业优选混合 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	7.52%	1.40%	7.41%	1.05%	0.11%	0.35%
过去六个月	0.57%	1.25%	3.35%	0.98%	-2.78%	0.27%
过去一年	12.08%	1.09%	18.26%	0.88%	-6.18%	0.21%
过去三年	-1.04%	1.18%	25.41%	0.98%	-26.45%	0.20%
自基金合同生效日起至今	-3.58%	1.13%	21.70%	0.96%	-25.28%	0.17%

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





注：本基金的基金合同于 2023 年 03 月 28 日生效，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

§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

贝莱德基金管理有限公司成立于 2020 年 9 月 10 日，是国内首家外资全资控股的公募基金管理公司。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准设立贝莱德基金管理有限公司的批复》（证监许可[2020]1917 号）批准，由贝莱德金融管理公司（BlackRock Financial Management,Inc.）出资成立。截至报告期末，公司旗下发行并管理了 19 只公开募集证券投资基金：贝莱德中国新视野混合型证券投资基金、贝莱德港股通远景视野混合型证券投资基金、贝莱德先进制造一年持有期混合型证券投资基金、贝莱德浦悦丰利混合型证券投资基金、贝莱德欣悦丰利债券型证券投资基金、贝莱德行业优选混合型证券投资基金、贝莱德安睿 30 天持有期债券型证券投资基金、贝莱德卓越远航混合型证券投资基金、贝莱德中债 0-3 年政策性金融债指数证券投资基金、贝莱德安裕 90 天持有期债券型证券投资基金、贝莱德沪深 300 指数增强型证券投资基金、贝莱德中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、贝莱德和悦利率债债券型证券投资基金、贝莱德中证 A500 指数增强型证券投资基金、贝莱德富元添益债券型证券投资基金、贝莱德安泽 60 天持有期债券型证券投资基金、贝莱德中债投资优选绿色债券指数证券投资基金、贝莱德中证 500 指数增强型证券投资基金、贝莱德富元金利混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
单秀丽	本基金的基金经理	2025 年 9 月 1 日		10 年	单秀丽女士，基金经理，曾任贝莱德投资管理（上海）有限公司投资经理，贝莱德资本管理公司（美国威明顿）量化风控/收益分析师。单秀丽女士是金融风险管理师（FRM）持证人，拥有美国里海大学理学硕士学位。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》 及行业协会的相关规定。

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

截至本报告期末，本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金无重大违法、违规行为，本基金投资运作符合有关法规及基金合同的约定。

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投资组合，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，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部相关公平交易制度等规定。

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，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

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

宏观经济层面，2026 年上半年中国经济呈现外需强、投资及内需弱复苏的结构性特征，出口

持续强劲增长拉动经济增速。股票市场开年经历了短暂的春季躁动后陷入震荡，等待政策及更多经济数据确认的过程中部分涨幅被消化。随后伴随中东冲突的爆发，投资者风险偏好剧烈收缩，全球权益资产不同程度受挫，A 股市场也经历了较为剧烈的风格切换。4 月中东冲突停火协议初步达成以来，地缘冲突的烈度降低，全球风险资产包括 A 股市场的情绪重新升温。在海外映射、产业趋势催化及盈利确定性等多重因素共振下，上半年市场出现了科技类行业大幅引领其他行业的结构性牛市态势。市场风格也展现出了强劲的大盘成长偏向，科创 50 指数上半年录得 64.25%正回报，而中证红利指数下跌 8.75%，资产类别间分化显著。从申万一级行业来看，各行业之间分化较大，电子、通信、建筑材料涨幅居前，商贸零售、农林牧渔、美容护理等表现垫底；港股层面，恒生科技和恒生价格指数以港元计分别跌 18.92%和 10.73%。从恒生一级行业来看，工业、综合企业、金融业表现较好，非必需性消费、原材料业、资讯科技业、必需性消费下跌超 15%，表现垫底。

在产品表现层面，截至 2026 年 6 月 30 日，本基金上半年取得了收益率 0.82%（A 类）及 0.57%（C 类），相较于业绩比较基准的超额收益为负，其中负超额收益主要来源于行业配置，个股选择超额收益贡献为正。其中行业维度，二季度相较于业绩比较基准超额收益贡献居前的行业板块为通信、食品饮料、汽车；而有色金属、传媒、非银金融对组合的超额收益拖累居前。本基金在上半年运用了股指期货优化组合的现金管理、灵活调节股票的风险敞口。

组合运作上，上半年整体保持较高股票仓位，根据市场情况相对基准适当超配或平配。一季度，基金重点配置了电力设备、非银金融、电子、传媒、银行等板块；一月份，受全球降息预期及国内基本面好转影响，组合股票持仓相对于基准处于超配，后续随着市场进入调整阶段，我们适度优化持仓，兑现部分高波动标的。在 3 月地缘冲突引发的市场调整中，我们进一步对组合进行优化，适度增加了冲突受益的行业及红利板块，增强组合的防御属性。二季度，基金重点配置了电子、有色金属、非银金融、电力设备、通信等板块；四月份至五月份，受停火协议及两国元首会面等地缘利好因素影响，市场迎来较好的涨幅，我们兑现部分高弹性标的，并在板块中进行一部分高切低，保持组合弹性。此外，增加了受益于冲突缓和及油价下降的部分标的并降低消费以及银行的比重。 进入 6 月份，市场呈现更加震荡格局，我们在不同行业之间的配置更加平衡分散。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 类份额净值 0.9800 元，本报告期内净值增长率 0.82%，同期业绩比较基准收益率 3.35%。截至本报告期末，本基金 C 类份额净值 0.9642 元，本报告期内净值增长率 0.57%，同期业绩比较基准收益率 3.35%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

后市我们仍坚持看好中国资产的观点不变，核心原因有三：一、宏观经济韧性十足，中国经济在复杂的地缘政治格局和国际油价波动中展现出超预期的抗压能力，未过多受外部冲击拖累。从增长动能来看，出口保持韧性，制造业投资维持高位，为整体经济提供了坚实支撑。上市公司盈利也正式进入兑现阶段：一季度全 A 整体盈利同比增长 7%左右，进入二季度，尽管完整财报尚未披露，但目前已公布的业绩预告和先行指标均指向盈利将进一步改善，市场一致预期二季度同比增速有望继续上行。

二、中国在科技和高端制造业具备全球优势。AI 领域中美是全球少数在五层分类上均有显著布局的国家，中国科技企业有望在成本、技术和商业模式上以综合实力参与全球竞争，部分半导体和发电储能企业基于蓝海定位和高门槛，基本面持续向好。近期海内外科技板块短期表现有所波动，但拉长至 24-36 个月维度，我们认为科技的牛市并未结束。全球科技股动量回调源于前期拥挤度过高和部分市场杠杆过高，而非头部公司基本面减速。AI 需求仍在指数级上升，浪潮刚刚兴起，优质资产近期回调后估值吸引力进一步增强，配置价值显现。

三、我们注意到，近年来 A 股市场在投资者回报机制方面发生了积极的结构性变化，分红率持续提升是最直观的体现。投资者回报和对投资者的保护均有实质性提升，这为中长期资金入市创造了更友好的制度环境。叠加估值层面，无论是和近十年的历史相比还是横向对比其他市场，大中盘股票均有吸引力，共同支撑我们对市场的看好。

此外，我们关注出口高增速掩盖的投资和内需的弱复苏，以及政策面或有的刺激投资和内需的措施。目前市场对此期待值不高，若出台强有力的刺激内需政策，泛消费类股票可能迎来修复性机会，比如现金流充沛的一些服务行业目前估值处于相对较低水平。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，委托基金服务机构对基金所持有的投资品种进行估值，本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。基金管理人及委托的基金服务机构严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，基金份额净值经基金托管人复核无误后由基金管理人对外披露。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、本基金基金合同的约定以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，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的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§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： 贝莱德行业优选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	469,975.30	1,547,102.15
结算备付金		217,279.19	5,698.82
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	68,498,808.20	90,113,320.37
其中：股票投资		64,963,834.36	85,169,540.65
基金投资		-	-
债券投资		3,534,973.84	4,943,779.72
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	207,002.07	2,899,343.49
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		33,405.59	-
应收申购款		11,717.26	65.93
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		69,438,187.61	94,565,530.76
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		54,351.38	407,311.65
应付管理人报酬		69,654.76	96,827.80
应付托管费		11,609.13	16,137.95
应付销售服务费		16,831.52	24,438.29
应付投资顾问费		-	-
应交税费		63.18	100.86
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	60,728.82	162,401.26
负债合计		213,238.79	707,217.81
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	71,309,464.87	97,369,068.95
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-2,084,516.05	-3,510,756.00
净资产合计		69,224,948.82	93,858,312.95
负债和净资产总计		69,438,187.61	94,565,530.76

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 71,309,464.87 份，其中 A 类基金份额净值 0.9800 元，基金份额 29,621,081.11 份；C 类基金份额净值 0.9642 元，基金份额 41,688,383.76

份。

6.2 利润表

会计主体：贝莱德行业优选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		1,772,419.51	6,776,390.24
1.利息收入		11,189.83	37,616.71
其中：存款利息收入	6.4.7.9	4,559.10	27,338.55
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		6,630.73	10,278.16
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,375,970.85	1,532,022.01
其中：股票投资收益	6.4.7.10	1,682,161.92	454,304.06
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	20,008.69	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-39,833.77	-
股利收益	6.4.7.13	713,634.01	1,077,717.95
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）	6.4.7.14	-617,322.72	5,206,111.84
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	2,581.55	639.68
减：二、营业总支出		720,185.04	1,251,244.08
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	469,016.53	814,907.89
其中：暂估管理人报酬		-	-
2．托管费	6.4.10.2.2	78,169.45	135,818.05

3．销售服务费		111,630.86	218,758.73
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		-	-
7．税金及附加		34.91	37.00
8．其他费用	6.4.7.16	61,333.29	81,722.41
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,052,234.47	5,525,146.16
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,052,234.47	5,525,146.16
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,052,234.47	5,525,146.16

6.3 净资产变动表

会计主体：贝莱德行业优选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	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	97,369,068.95	-	-3,510,756.00	93,858,312.95
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	97,369,068.95	-	-3,510,756.00	93,858,312.95
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-26,059,604.08	-	1,426,239.95	-24,633,364.13
（一）、综合收益总额	-	-	1,052,234.47	1,052,234.47
（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）	-26,059,604.08	-	374,005.48	-25,685,598.60

其中：1.基金申购款	1,767,845.61	-	-33,892.06	1,733,953.55
2.基金赎回款	-27,827,449.69	-	407,897.54	-27,419,552.15
（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	71,309,464.87	-	-2,084,516.05	69,224,948.82
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	175,255,670.99	-	-30,016,462.21	145,239,208.78
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	175,255,670.99	-	-30,016,462.21	145,239,208.78
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-25,555,567.21	-	9,636,205.03	-15,919,362.18
（一）、综合收益总额	-	-	5,525,146.16	5,525,146.16
（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）	-25,555,567.21	-	4,111,058.87	-21,444,508.34
其中：1.基金申购款	2,483,550.06	-	-415,059.36	2,068,490.70
2.基金赎回款	-28,039,117.27	-	4,526,118.23	-23,512,999.04
（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	149,700,103.78	-	-20,380,257.18	129,319,846.60

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：

郁蓓华	杨怡	徐菱莲
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

贝莱德行业优选混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2022]2569 号《关于准予贝莱德行业优选混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，由贝莱德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《贝莱德行业优选混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 438,652,899.79 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2023)第 0188 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《贝莱德行业优选混合型证券投资基金基金合同》于 2023 年 3 月 28 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 438,821,029.69 份基金份额，其中认购资金利息折合 168,129.90 份基金份额。本基金的基金管理人为贝莱德基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《贝莱德行业优选混合型证券投资基金基金合同》和《贝莱德行业优选混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。其中：在投资者认购、申购时收取认购、申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购、申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净

值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《贝莱德行业优选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(包括主板、创业板及其他中国证监会允许上市的股票、存托凭证)、港股通标的股票、债券(国债、金融债、企业债、公司债、政府支持债券、政府支持机构债券、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、可交换债券、次级债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、金融衍生品(包括股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品等)、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具，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相关规定)。本基金可根据法律法规和基金合同的约定，参与融资融券业务中的融资业务。本基金的投资组合比例为：本基金股票资产(含存托凭证)占基金资产的比例为 60%-95%，其中，港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-20%；每个交易日日终在扣除国债期货合约、股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×75%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×15%+一年期定期存款利率(税后)×10%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年上半年度的经营成果和净资产变动情况。

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

本基金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。

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

本基金本报告期无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日上海交易所发布的《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳交易所发布的《关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2021]33 号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财税[2024]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》、国务院令第 826 号《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》、财税[2026]12 号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)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、债券取得的收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；2027 年 12 月 31 日前，公开募集证券投资基金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，以基金管理人为增值税纳税人，可以选择适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

(2)对证券投资基金取得的自 2025 年 8 月 8 日之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复缴纳增值税；取得的在 2025 年 8 月 8 日之前已发行的国债、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。

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

(4)对证券投资基金取得的股票股息红利所得，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。其中，对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股，解禁后取得的股息红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。对基金通过港股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。基金通过港股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。

(5)对于证券投资基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税；自 2023 年 8 月 28 日起，出让方减按 0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。对于基金通过港股通买卖、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。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	58,421.77
等于：本金	58,397.97
加：应计利息	23.80
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	411,553.53
等于：本金	411,508.44
加：应计利息	45.09

减：坏账准备	-
合计	469,975.30

注：其他存款为存放在证券经纪商的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		62,101,859.38	-	64,963,834.36	2,861,974.98
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	3,501,428.00	33,223.84	3,534,973.84	322.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	3,501,428.00	33,223.84	3,534,973.84	322.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		65,603,287.38	33,223.84	68,498,808.20	2,862,296.98

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

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	207,002.07	-
银行间市场	-	-
合计	207,002.07	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

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	32.28
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	60,696.54
合计	60,728.82

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

贝莱德行业优选混合 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	38,347,291.16	38,347,291.16
本期申购	1,053,382.56	1,053,382.56
本期赎回（以“-”号填列）	-9,779,592.61	-9,779,592.61
本期末	29,621,081.11	29,621,081.11

贝莱德行业优选混合 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	59,021,777.79	59,021,777.79
本期申购	714,463.05	714,463.05
本期赎回（以“-”号填列）	-18,047,857.08	-18,047,857.08
本期末	41,688,383.76	41,688,383.76

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

贝莱德行业优选混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-499,158.48	-572,857.43	-1,072,015.91
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-499,158.48	-572,857.43	-1,072,015.91
本期利润	741,439.54	-286,360.79	455,078.75
本期基金份额交易产生的变动数	74,879.09	-49,657.91	25,221.18

其中：基金申购款	-1,799.32	-10,771.09	-12,570.41
基金赎回款	76,678.41	-38,886.82	37,791.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	317,160.15	-908,876.13	-591,715.98

贝莱德行业优选混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,596,801.00	-841,939.09	-2,438,740.09
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-1,596,801.00	-841,939.09	-2,438,740.09
本期利润	928,117.65	-330,961.93	597,155.72
本期基金份额交易产生的变动数	415,041.84	-66,257.54	348,784.30
其中：基金申购款	-19,431.17	-1,890.48	-21,321.65
基金赎回款	434,473.01	-64,367.06	370,105.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-253,641.51	-1,239,158.56	-1,492,800.07

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	599.37
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	2,545.59
结算备付金利息收入	1,414.14
其他	-
合计	4,559.10

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商的证券交易结算资金的利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,682,161.92
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	1,682,161.92

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	126,719,218.67
减：卖出股票成本总额	124,820,415.93
减：交易费用	216,640.82
买卖股票差价收入	1,682,161.92

6.4.7.10.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益-证券出借差价收入。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	20,032.00
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-23.31
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	20,008.69

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 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	3,542,568.22
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,500,665.00
减：应计利息总额	41,888.22
减：交易费用	38.31
买卖债券差价收入	-23.31

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.12 衍生工具收益

6.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

6.4.7.12.2 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	-39,833.77

6.4.7.13 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	713,634.01
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	713,634.01

6.4.7.14 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	-617,322.72
股票投资	-617,450.72
债券投资	128.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2.衍生工具	-
权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-617,322.72

6.4.7.15 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	1,990.22
基金转换费收入	591.33
合计	2,581.55

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 50%归入基金资产。

6.4.7.16 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	21,024.96
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
证券组合费	461.75
汇划手续费	175.00
合计	61,333.29

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

根据 2026 年 6 月 26 日本基金管理人贝莱德基金管理有限公司发布的《贝莱德基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告》，本基金的业绩比较基准自 2026 年 7 月 27 日起，由“沪深 300 指数收益率×75%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×15%+一年期定期存款利率(税后)×10%”变更为“中证 800 指数收益率×75%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×15%+中债-新综合财富(总值)指数收益率×5%+活期存款基准利率×5% ”。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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
贝莱德基金管理有限公司(“贝莱德基金”)	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、注册登记机构、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	469,016.53	814,907.89
其中：应支付销售机构的客户维护费	233,847.64	403,306.29
应支付基金管理人的净管理费	235,168.89	411,601.60

注： 支付基金管理人贝莱德基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.20%÷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	78,169.45	135,818.05

注：支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%÷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		
	贝莱德行业优选混合 A	贝莱德行业优选混合 C	合计

中国建设银行	-	4,255.60	4,255.60
合计	-	4,255.60	4,255.60
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		
	贝莱德行业优选混合 A	贝莱德行业优选混合 C	合计
中国建设银行	-	6,803.40	6,803.40
合计	-	6,803.40	6,803.40

注：本基金实行销售服务费分级收费方式，分设 A、C 两类基金份额。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费；C 类基金的销售服务费按前一日 C 类基金份额对应的资产净值 0.50%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：日销售服务费=前一日 C 类基金份额对应的资产净值×0.50%÷当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均无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均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 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
中国建设银行	58,421.77	599.37	234,388.04	980.65

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率或协议利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间均未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无因参与转融通证券出借业务而出借的证券。

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

本基金为混合型基金，其预期风险和收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。本基金如果投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金主要投资于依法发行上市的股票、港股通标的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金在日常投资管理中面

临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。本基金的基金管理人致力于全面风险管理体系的建立，建立了由董事会、公司管理层、风险管理部门和业务职能部门构成的四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。董事会对风险管理的责任包括制定业务战略和风险管理目标、审阅重大事件和决策的风险评估等；管理层负责风险管理政策、风险控制措施的制定和落实，确保有效管理所有重大风险，下设风险管理委员会，根据董事会和管理层的授权开展风险管理工作；风险管理部门负责风险评估、报告、监控和管理，主要职责包括制定公司风险管理制度和程序、实施定量和定性的风险评估等；业务职能部门从经营管理的各业务环节上贯彻落实风险管理措施。在业务操作层面，各部门积极配合风险管理部门完成运作风险管理，其他中后台部门包括但不限于财务、合规稽核和运营等部门在各自职能范围内支持或监督公司风险管理。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要通过定性和定量相结合的分析方法去评估各种相关风险可能造成的影响。从定性分析的角度出发，判断风险的种类、风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频率。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、模型和日常风险报告等，确定基金资产的风险状态及其是否符合基金的风险特征，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内 。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券发行人出现违约、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。

本基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用评级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算，对手为中国证券登记结算有限责任公司；在银行间同业市场根据交易类型采取白名单和黑名单相结合的方式防范交易对手风险。

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固定收益品种占基金资产净值的比例为 0.00%(上年度末：0.00%)。

6.4.13.3 流动性风险

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

理的价格变现。

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

于本报告期末，本基金所承担的全部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，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金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发行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 6.4.12。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%。于本报告期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

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。于本报告期末，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易

的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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。

本基金持有的利率敏感性资产存在相应的利率风险。本期持有银行存款和债券投资等利率敏感性资产。

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	469,975.30	-	-	-	469,975.30
结算备付金	217,279.19	-	-	-	217,279.19
交易性金融资产	3,534,973.84	-	-	64,963,834.36	68,498,808.20
买入返售金融资产	207,002.07	-	-	-	207,002.07
应收股利	-	-	-	33,405.59	33,405.59
应收申购款	-	-	-	11,717.26	11,717.26
资产总计	4,429,230.40	-	-	65,008,957.21	69,438,187.61
负债					
应付赎回款	-	-	-	54,351.38	54,351.38
应付管理人报酬	-	-	-	69,654.76	69,654.76
应付托管费	-	-	-	11,609.13	11,609.13
应付销售服务费	-	-	-	16,831.52	16,831.52
应交税费	-	-	-	63.18	63.18
其他负债	-	-	-	60,728.82	60,728.82
负债总计	-	-	-	213,238.79	213,238.79
利率敏感度缺口	4,429,230.40	-	-	64,795,718.42	69,224,948.82

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	1,547,102.15	-	-	-	1,547,102.15
结算备付金	5,698.82	-	-	-	5,698.82
交易性金融资产	4,943,779.72	-	-	85,169,540.65	90,113,320.37
买入返售金融资产	2,899,343.49	-	-	-	2,899,343.49
应收申购款	-	-	-	65.93	65.93
资产总计	9,395,924.18	-	-	85,169,606.58	94,565,530.76
负债					
应付赎回款	-	-	-	407,311.65	407,311.65
应付管理人报酬	-	-	-	96,827.80	96,827.80
应付托管费	-	-	-	16,137.95	16,137.95
应付销售服务费	-	-	-	24,438.29	24,438.29
应交税费	-	-	-	100.86	100.86
其他负债	-	-	-	162,401.26	162,401.26
负债总计	-	-	-	707,217.81	707,217.81
利率敏感度缺口	9,395,924.18	-	-	84,462,388.77	93,858,312.95

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的到期日予以分类。

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 ）
	利率上升 25bp	-2,417.37	-4,520.33
	利率下降 25bp	2,423.06	4,529.59

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日				
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	-	其他币种 折合人民币	合计

以外币计价的资产					
交易性金融资产	-	7,889,001.46	-	-	7,889,001.46
应收股利	-	9,064.79	-	-	9,064.79
资产合计	-	7,898,066.25	-	-	7,898,066.25
以外币计价的负债					
负债合计	-	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	7,898,066.25	-	-	7,898,066.25

项目	上年度末 2025 年 12 月 31 日				
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	-	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产					
交易性金融资产	-	12,488,038.95	-	-	12,488,038.95
资产合计	-	12,488,038.95	-	-	12,488,038.95
以外币计价的负债					
负债合计	-	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	12,488,038.95	-	-	12,488,038.95

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末 （2025 年 12 月 31 日 ）
	所有外币相对人民币升值 5%	394,903.31	624,401.95

	所有外币相对人民币贬值 5%	-394,903.31	-624,401.95

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注重严格风险控制的基础上，动态调整资产配置，使风险和预期目标相匹配，并选择符合基金合同约定范围内的投资品种进行投资。同时，本基金充分发挥基金管理人的研究优势，通过对经济发展、社会结构、宏观政策、产业政策和科学技术的跟踪研究，将定性分析和定量模型相结合，根据投资策略或市场环境的变化构建和管理投资组合，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金投资组合中股票资产(含存托凭证)占基金资产的比例为 60%-95%，其中，港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-20%。每个交易日日终在扣除国债期货合约、股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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，以识别和测算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	64,963,834.36	93.84	85,169,540.65	90.74
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	64,963,834.36	93.84	85,169,540.65	90.74

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	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%	4,902,474.00	5,423,532.83
	业绩比较基准下降 5%	-4,902,474.00	-5,423,532.83

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	64,963,834.36	85,169,540.65
第二层次	3,534,973.84	4,943,779.72
第三层次	-	-
合计	68,498,808.20	90,113,320.37

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

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货币资金、应收款项和其他金融负债，其公允价值和账面价值相等。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日，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	64,963,834.36	93.56
	其中：股票	64,963,834.36	93.56
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,534,973.84	5.09
	其中：债券	3,534,973.84	5.09
	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	207,002.07	0.30
	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	687,254.49	0.99
8	其他各项资产	45,122.85	0.06
9	合计	69,438,187.61	100.00

注：1、本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 7,889,001.46 元，占资产净值比例为 11.40%。

2、本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

3、本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,585,516.00	3.73
C	制造业	40,716,323.20	58.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	135,599.00	0.20
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,597,867.70	2.31
J	金融业	10,487,943.00	15.15
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,551,584.00	2.24
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	57,074,832.90	82.45

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
主要消费	237,357.34	0.34
原材料	66,442.34	0.10
通信服务	3,947,333.93	5.70
信息技术	1,776,532.18	2.57
能源	427,187.63	0.62
工业	239,024.96	0.35
医药卫生	303,717.18	0.44
可选消费	891,405.90	1.29
合计	7,889,001.46	11.40

注：以上分类采用中证行业分类标准。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	3,700	4,699,000.00	6.79
2	300750	宁德时代	11,800	4,637,518.00	6.70
3	00700	腾讯控股	8,500	3,173,073.72	4.58
4	002415	海康威视	88,300	3,019,860.00	4.36
5	688396	华润微	29,600	2,887,480.00	4.17
6	601318	中国平安	60,000	2,864,400.00	4.14
7	600036	招商银行	76,500	2,715,750.00	3.92
8	002384	东山精密	9,600	2,518,560.00	3.64
9	688002	睿创微纳	16,100	2,490,509.00	3.60
10	300502	新易盛	4,100	2,488,700.00	3.60
11	600309	万华化学	33,600	2,298,576.00	3.32
12	002353	杰瑞股份	14,700	2,241,750.00	3.24
13	600109	国金证券	253,300	2,223,974.00	3.21
14	601601	中国太保	67,600	1,927,952.00	2.79
15	601857	中国石油	153,600	1,333,248.00	1.93
15	00857	中国石油股份	58,000	427,187.63	0.62
16	688256	寒武纪	894	1,426,421.70	2.06
17	002738	中矿资源	21,700	1,280,083.00	1.85
18	603986	兆易创新	1,500	1,222,500.00	1.77
19	000807	云铝股份	52,900	1,171,206.00	1.69
20	300012	华测检测	83,200	1,153,152.00	1.67
21	002532	天山铝业	96,500	1,035,445.00	1.50
22	000338	潍柴动力	36,500	994,625.00	1.44
23	00522	ASMPT	4,300	891,861.88	1.29
24	01860	汇量科技	88,000	774,260.21	1.12
25	002001	新和成	26,600	755,972.00	1.09
26	688498	源杰科技	400	754,400.00	1.09
27	002603	以岭药业	44,400	666,000.00	0.96
28	601899	紫金矿业	24,700	620,958.00	0.90
29	002487	大金重工	10,200	591,294.00	0.85
30	000933	神火股份	24,100	510,920.00	0.74
31	002142	宁波银行	16,800	498,792.00	0.72
32	600489	中金黄金	27,000	487,350.00	0.70
33	002008	大族激光	2,900	435,319.00	0.63
34	00981	中芯国际	5,500	427,066.04	0.62
35	605117	德业股份	4,020	426,843.60	0.62
36	603259	药明康德	3,200	398,432.00	0.58
37	600183	生益科技	2,200	381,480.00	0.55
38	600316	洪都航空	13,200	368,808.00	0.53

39	00881	中升控股	86,500	364,378.44	0.53
40	600066	宇通客车	13,500	361,935.00	0.52
41	00992	联想集团	18,000	359,892.38	0.52
42	09992	泡泡玛特	2,600	349,348.18	0.50
43	300450	先导智能	7,800	317,616.00	0.46
44	300124	汇川技术	3,900	258,687.00	0.37
45	600111	北方稀土	5,000	240,250.00	0.35
46	06865	福莱特玻璃	43,000	239,024.96	0.35
47	000792	盐湖股份	6,300	190,197.00	0.27
48	01112	H＆H国际控股	20,000	176,836.78	0.26
49	300033	同花顺	700	168,700.00	0.24
50	300677	英科医疗	3,600	141,012.00	0.20
51	300661	圣邦股份	900	129,132.00	0.19
52	600741	华域汽车	8,000	124,160.00	0.18
53	000408	藏格矿业	1,700	117,844.00	0.17
54	600010	包钢股份	46,000	102,580.00	0.15
55	01070	ＴＣＬ电子	9,000	100,760.49	0.15
56	09611	龙旗科技	4,500	97,711.88	0.14
57	300394	天孚通信	320	96,857.60	0.14
58	600549	厦门钨业	1,100	93,720.00	0.14
59	603993	洛阳钼业	5,200	91,260.00	0.13
60	601398	工商银行	12,500	88,375.00	0.13
61	00656	复星国际	25,000	86,420.73	0.12
62	002602	世纪华通	6,100	86,010.00	0.12
63	02096	先声药业	10,000	85,552.18	0.12
64	002558	巨人网络	3,100	85,436.00	0.12
65	600522	中天科技	1,400	84,952.00	0.12
66	601233	桐昆股份	3,700	80,105.00	0.12
67	002841	视源股份	2,300	79,419.00	0.11
68	600875	东方电气	2,700	77,679.00	0.11
69	00590	六福集团	4,000	76,918.79	0.11
70	600893	航发动力	2,000	76,680.00	0.11
71	600426	华鲁恒升	3,200	76,544.00	0.11
72	600031	三一重工	4,400	76,032.00	0.11
73	600018	上港集团	15,700	74,104.00	0.11
74	01066	威高股份	26,400	72,687.21	0.11
75	600038	中直股份	2,700	68,283.00	0.10
76	06680	金力永磁	4,600	66,442.34	0.10
77	601872	招商轮船	3,500	61,495.00	0.09
78	09980	东鹏饮料	650	60,520.56	0.09
79	02196	复星医药	4,500	59,057.06	0.09
80	000975	山金国际	3,100	52,700.00	0.08
81	002916	深南电路	100	45,790.00	0.07

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	603444	吉比特	3,732,809.00	3.98
2	601601	中国太保	3,070,340.00	3.27
3	688012	中微公司	3,068,225.57	3.27
4	688396	华润微	3,008,844.25	3.21
5	600309	万华化学	2,756,612.14	2.94
6	688002	睿创微纳	2,342,348.64	2.50
7	002384	东山精密	2,319,554.00	2.47
8	002353	杰瑞股份	2,248,818.00	2.40
9	600109	国金证券	2,235,822.00	2.38
10	000338	潍柴动力	2,019,962.00	2.15
11	002532	天山铝业	1,934,507.00	2.06
12	600019	宝钢股份	1,884,838.00	2.01
13	000807	云铝股份	1,854,735.00	1.98
14	000157	中联重科	1,766,524.00	1.88
15	601865	福莱特	1,639,505.00	1.75
16	002738	中矿资源	1,638,876.00	1.75
17	601857	中国石油	1,629,898.00	1.74
18	01860	汇量科技	1,590,608.71	1.69
19	00386	中国石油化工股份	1,554,930.29	1.66
20	601166	兴业银行	1,520,926.00	1.62

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	600019	宝钢股份	5,329,782.00	5.68
2	000725	京东方 A	5,279,200.00	5.62
3	000333	美的集团	4,904,945.60	5.23
4	600276	恒瑞医药	4,727,775.00	5.04
5	600031	三一重工	3,819,925.25	4.07
6	300274	阳光电源	3,818,384.00	4.07
7	600660	福耀玻璃	3,792,068.00	4.04
8	688012	中微公司	3,760,107.16	4.01
9	603444	吉比特	3,541,692.00	3.77
10	02318	中国平安	3,340,872.16	3.56
11	300308	中际旭创	3,101,738.00	3.30

12	000338	潍柴动力	3,080,767.00	3.28
13	601865	福莱特	3,017,045.00	3.21
14	603986	兆易创新	2,711,310.00	2.89
15	300750	宁德时代	2,051,085.00	2.19
16	002415	海康威视	1,959,988.00	2.09
17	002142	宁波银行	1,902,022.38	2.03
18	601899	紫金矿业	1,890,789.00	2.01
19	600519	贵州茅台	1,876,178.00	2.00
20	601995	中金公司	1,784,508.00	1.90

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	105,232,160.36
卖出股票收入（成交）总额	126,719,218.67

注：“买入股票成本（成交）总额” 和“卖出股票收入（成交）总额”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	3,534,973.84	5.11
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,534,973.84	5.11

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	019785	25 国债 13	20,000	2,025,250.96	2.93
2	019827	26 国债 01	15,000	1,509,722.88	2.18

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

本基金以套期保值与风险敞口管理为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适度参与股指期货投资。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，运用股指期货管理现金流、减少系统性风险以及降低特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等。

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

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到处罚。上述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。

7.12.2

本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。

7.12.3 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	33,405.59
4	应收利息	-
5	应收申购款	11,717.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	45,122.85

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，投资组合报告中市值占净值比例的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
贝莱德行业优选混合 A	513	57,740.90	0.00	0.00 %	29,621,081.11	100.00 %
贝莱德行业优选混合 C	786	53,038.66	550,157.50	1.32 %	41,138,226.26	98.68 %
合计	1,299	54,895.66	550,157.50	0.77 %	70,759,307.37	99.23 %

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 07 月 01 日-2026 年 06 月 30 日）
盈利投资者数量占比（%）	92.97

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	贝莱德行业优选混合 A	52,833.49	0.1784 %
	贝莱德行业优选混合 C	60,017.55	0.1440 %
	合计	112,851.04	0.1583 %

注：从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	贝莱德行业优选混合 A	0
	贝莱德行业优选混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	贝莱德行业优选混合 A	0~10
	贝莱德行业优选混合 C	0
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	贝莱德行业优选混合 A	贝莱德行业优选混合 C
基金合同生效日（2023 年 3 月 28 日）基金份额总额	106,275,790.63	332,545,239.06
本报告期期初基金份额总额	38,347,291.16	59,021,777.79
本报告期基金总申购份额	1,053,382.56	714,463.05
减：本报告期基金总赎回份额	9,779,592.61	18,047,857.08
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	29,621,081.11	41,688,383.76

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：2026 年上半年，基金管理人未发生重大人事变动。

基金托管人：本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及影响基金管理人经营或基金运营业务，或与基金财产相关的诉讼。

本报告期无涉及基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金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，为本基金进行审计的机构未发生变化，为德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）。

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

本报告期内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

本报告期内托管人相关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(%)	
国泰海通证券股份有限公司	2	231,951,379.03	100.00	109,349.08	100.00	-

注：1、此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、债券、债券回购、权证等交易（如有）而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

2、本基金采用券商交易模式。根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，基金管理人管理的采用券商交易模式的基金，不适用有关交易佣金集中度限制的规定。

3、本基金管理人选择财务状况良好、经营行为规范、研究实力较强、能满足公募基金采用

券商交易模式进行证券交易和结算需要的证券公司作为本基金的证券经纪商。

4、本基金管理人与选择的证券经纪商、本基金的托管人签订证券经纪服务协议，对账户管理、资金存管、交易执行、交易管理、佣金收取、清算交收、违约责任等作出约定。

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

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
国泰海通证券股份有限公司	3,801,637.00	100.00	116,997,000.00	100.00	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	贝莱德基金管理公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	中国证监会规定媒介	2026 年 3 月 31 日
2	贝莱德行业优选混合型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2026 年 4 月 22 日
3	贝莱德行业优选混合型证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒介	2026 年 6 月 26 日
4	贝莱德行业优选混合型证券投资基金托管协议	中国证监会规定媒介	2026 年 6 月 26 日
5	贝莱德基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告	中国证监会规定媒介	2026 年 6 月 26 日
6	贝莱德行业优选混合型证券投资基金（A 类份额）产品资料概要更新（2026 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2026 年 6 月 27 日
7	贝莱德行业优选混合型证券投资基金（C 类份额）产品资料概要更新（2026 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2026 年 6 月 27 日
8	贝莱德行业优选混合型证券投资基金招募说明书更新（2026 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2026 年 6 月 27 日

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内未发生单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、本基金的中国证监会批准募集文件

2、本基金的基金合同

3、本基金的招募说明书

4、本基金的托管协议

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、本基金的公告

7、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人的办公场所:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 7 楼 702 室。

12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站（www.blackrock.com.cn）查阅，或在营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅。

贝莱德基金管理有限公司

2026 年 8 月 31 日