

联博汇利债券型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人：联博基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2026 年 08 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 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	8
4.1	基金管理人及基金经理情况	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	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	13
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	14
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1	资产负债表	14
6.2	利润表	15
6.3	净资产变动表	16
6.4	报表附注	17
§ 7	投资组合报告	38
7.1	期末基金资产组合情况	39
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	44
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	44
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	44
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	45

§ 8	基金份额持有人信息	46
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	46
§ 9	开放式基金份额变动	47
§ 10	重大事件揭示	47
10.1	基金份额持有人大会决议	47
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	47
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	48
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	48
10.6	管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	48
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	48
10.8	其他重大事件	49
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	50
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	50
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	51
§ 12	备查文件目录	51
12.1	备查文件目录	51
12.2	存放地点	51
12.3	查阅方式	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	联博汇利债券型证券投资基金	
基金简称	联博汇利债券	
基金主代码	023087	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 06 月 04 日	
基金管理人	联博基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	204,846,629.90 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	联博汇利债券 A	联博汇利债券 C
下属分级基金的交易代码	023087	023088
报告期末下属分级基金的份额总额	48,485,459.77 份	156,361,170.13 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过积极主动的投资管理，合理配置固定收益类资产和权益类资产，以降低组合波动为目标，力争实现基金资产长期稳健增值。
投资策略	1、资产配置策略 2、债券投资策略 3、股票投资策略 4、存托凭证投资策略 5、国债期货投资策略 6、信用衍生品投资策略 7、基金投资策略
业绩比较基准	中债新综合财富(总值)指数收益率*85%+中证 800 指数收益率*10%+1 年期定期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金为债券型基金，一般而言，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

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		联博基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王玲	方圆
	联系电话	021-80276528	95559
	电子邮箱	Iris.Wang@alliancebernstein.com.cn	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		4000011300	95559
传真		021-52560862-9999	021-62701216

注册地址	中国上海市静安区石门一路 288 号兴业太古汇香港兴业中心二座 16 楼 1606 室	中国(上海)自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址	中国上海市静安区石门一路 288 号兴业太古汇香港兴业中心二座 16 楼 1606 室	中国(上海)长宁区仙霞路 18 号
邮政编码	200041	200336
法定代表人	罗登攀	任德奇

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	https://www.alliancebernstein.com.cn/
基金中期报告置备地点	基金管理人办公场所及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	联博基金管理有限公司	中国上海市静安区石门一路 288 号兴业太古汇香港兴业中心二座 16 楼 1606 室

§ 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 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）	
	联博汇利债券 A	联博汇利债券 C
本期已实现收益	1,333,256.35	2,576,676.98
本期利润	1,561,239.32	2,792,038.72
加权平均基金份额本期利润	0.0247	0.0193
本期加权平均净值利润率	2.37%	1.86%
本期基金份额净值增长率	2.43%	2.23%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
	联博汇利债券 A	联博汇利债券 C
期末可供分配利润	2,736,906.22	8,120,655.24
期末可供分配基金份额利润	0.0564	0.0519
期末基金资产净值	51,263,973.48	164,614,758.91
期末基金份额净值	1.0573	1.0528
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
	联博汇利债券 A	联博汇利债券 C
基金份额累计净值增长率	5.73%	5.28%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、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。

3、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。

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

联博汇利债券 A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①－③	②－④
过去三个月	2.31%	0.14%	2.39%	0.14%	-0.08%	0.00%
过去六个月	2.43%	0.14%	2.92%	0.13%	-0.49%	0.01%
过去一年	5.39%	0.13%	4.54%	0.12%	0.85%	0.01%
自基金合同生 效起至今	5.73%	0.13%	5.25%	0.11%	0.48%	0.02%

联博汇利债券 C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①－③	②－④
过去三个月	2.21%	0.14%	2.39%	0.14%	-0.18%	0.00%
过去六个月	2.23%	0.14%	2.92%	0.13%	-0.69%	0.01%
过去一年	4.97%	0.13%	4.54%	0.12%	0.43%	0.01%
自基金合同生 效起至今	5.28%	0.12%	5.25%	0.11%	0.03%	0.01%

注：本基金合同生效日为 2025 年 6 月 4 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

联博汇利债券 A



联博汇利债券 C



注：本基金建仓期为基金合同生效日起的 6 个月，报告期末本基金已建仓完毕。截至建仓期结束，各项资产配置比例符合本基金合同约定。

§ 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

联博基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）于 2021 年 9 月 3 日成立。公司经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）2023 年 3 月 3 日《关于核准设立联博基金管理有限公司的批复》（证监许可[2023]464 号）核准设立，并于 2023 年 12 月 29 日取得中国证监会核发的《中华人民共和国经营证券期货业务许可证》。公司股东为联博香港有限公司，注册资本为人民币 60000 万元。

截至 2026 年 06 月 30 日，公司公开募集证券投资基金资产管理规模为人民币 5.62 亿元，包括联博智选混合型证券投资基金、联博智远混合型证券投资基金、联博汇利债券型证券投资基金、联博中证 500 指数增强型证券投资基金 4 只产品。

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		
张亦博	基金经理	2025 年 06 月 04 日	-	15 年	基金经理，负责管理联博基金的多元资产投资组合和资产配置策略，澳大利亚莫纳什大学风险管理学硕士，特许金融分析师(CFA)，在 2022 年加入联博集团之前，曾任嘉合基金基金配置管理部副总监和基金经理、蜂巢基金资产管理部副总监、财通基金固定收益部基金经理、华宝证券有限责任公司资产管理部固定收益投资经理、东吴证券股份有限公司资产管理部债券研究员、德邦证券有限责任公司研究所研究员。
倪文乐	基金经理	2025 年 06 月 04 日	-	6 年	基金经理，北京外国语大学经济学学士和香港大学工商管理硕士，金融风险管理师

					(FRM)。在 2023 年加入联博集团之前，曾任野村东方国际证券资产管理部投资组合经理和固定收益投资负责人、平安信托有限责任公司固定收益部高级固定收益投资组合经理、上海浦东发展银行金融市场部高级交易员、香港汇丰银行环球市场部交易员、渣打银行管理培训生。
何旻	基金经理、固定收益投资总监	2026 年 04 月 28 日	-	27 年	基金经理，联博基金管理有限公司固定收益投资总监。在 2025 年加入联博基金之前，曾任汇添富基金管理有限公司基金经理，汇添富资产管理（香港）有限公司基金经理，金元顺安基金管理有限公司基金经理，国泰基金管理有限公司基金经理、投资助理、研究员。何旻先生拥有英国伦敦政治经济学院金融经济学硕士和华东师范大学经济学学士学位。

注：1. 此处的任职日期和离职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中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.3 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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、规范性文件要求和本基金基金合同约定，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，基金运作无违法违规、未履行基金合同或其他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

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司建立了公平交易相关制度体系，使得不同投资组合在投资管理活动中得到公平对待，严格防范不同投资组合之间进行利益输送。在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格控制公平交易执行，确保所有组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

本报告期内，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。公司对各投资组合公平对待，不存在不公平交易或利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本组合与其他投资组合之间未出现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

2026 年上半年，境内经济呈现“K 型”特征，与科技制造相关的工业生产和出口表现亮眼，而与传统消费、地产等相关的板块表现相对疲弱。与此同时，外围地缘政治事件频发，美伊冲突的反复对全球通胀和经济增长前景均产生了较大影响。产业方面，AI 资本开支仍在增长，但关于其增速可持续性以及投资回报兑现能力的讨论也愈加激烈。

在此背景下，A 股市场整体表现震荡上行，但结构分化较为明显，沪深 300 指数上半年上涨 7.55%，而创业板指和科创综指涨幅分别为 35.58% 和 53.99%。板块上，电子、通信等 AI 相关板块表现亮眼，涨幅在 70% 以上，而商贸零售、农林牧渔、美容护理等消费相关板块表现落后，跌幅都在 20% 以上。股票市场的运行亦反映了经济的“K 型”结构特征。

债券市场方面，转型时期的经济基本面并未给利率带来太大的上行压力，而资金面整体保持充裕状态，配置盘和交易盘陆续布局，期间虽有中东冲突及其影响的扰动，但债券市场在今年上半年整体走牛，10 年期国债利率从年初的 1.84% 左右下行至年中的 1.73% 左右。

本基金继续在风险预算的严格约束下，通过量化模型和基本面相结合的方式及时调整资产配置比例，以优化组合风险收益特征。具体而言，在权益部分，我们继续秉持成长和价值相结合的均衡分散思路，积极布局了深度融入全球产业链的高质量 AI 硬件企业，与此同时，面对科技相关板块波动增大的现状，我们也在包括医药、金融等领域进行了配置，以多元分散和高质量选股来降低权益部分的波动。在债券部分，本基金以高质量信用债为主、以利率债为辅进行灵活调节，并依据市场情况适时调整组合久期。例如，在美伊冲突爆发初期我们曾适当降低久期以减少波动，但在事件影响逐渐减弱后，我们再次增加久期，并将结构向哑铃结构偏移。通过灵活的波段操作，我们力争在票息收入的基础上，获得更多的资本利得。在资产配置部分，我们战略上坚守产品长期的风险收益特征定位，战术上积极管理权益敞口，在寻求收益的同时管控风险，用好量化模型工具，力求在不确定性较强的市场中提供更优的持有体验。

本基金将继续以风险预算为准绳，通过均衡分散的方式布局风险资产，并以量化指标为基础进行动态资产配置调整，尽量减少主观判断可能造成的失误，继续力争为投资人创造更优的风险调整后收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末联博汇利债券 A 份额净值为 1.0573 元，本报告期联博汇利债券 A 份额净值增长率为 2.43%，同期业绩比较基准收益率为 2.92%；截至本报告期末联博汇利债券 C 份额净值为 1.0528 元，本报告期联博汇利债券 C 份额净值增长率为 2.23%，同期业绩比较基准收益率为 2.92%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年下半年，我们预计宏观经济的“K 型”特征或不会明显改变，政策将在保持定力的基础上适当加力，以供给侧措施为主，需求侧支持则更加温和。

基于此，我们认为，在今年上半年走出结构性行情的 AI 板块的基本面叙事依然稳固：全球 AI 算力需求仍具备景气支撑，存储、硬件产业链盈利趋势明确，中国出口升级与国产替代的长期逻辑

也同步持续兑现。不过，AI 科技板块盈利预测普遍计入了较为乐观的远期假设，令前瞻估值有所失真，叠加亚太市场个人投资者交易热度攀升，全球 AI 资本开支增速或临近高点，以及主要央行转向货币紧缩，预计高景气科技成长板块的波动风险正在持续上升。

在此背景下，我们认为均衡分散仍是当下更具优势的投资策略之一，既聚焦盈利确定性强的 AI 硬件优质标的，参与产业长期趋势；同时布局现金流稳定、估值合理的非 AI 板块，如净息差企稳、分红改善的银行板块，以及受益于油价回落的部分消费板块，或有望部分对冲 AI 科技企业的集中性风险。

债券方面，我们认为，由于经济的“K 型”分化仍然存在，且整体仍处于结构转型的过程中，利率水平大幅上升的风险较低。同时，央行继续呵护资金面稳定的态度并未改变，也对债市形成一定的支撑。需要注意的是三季度可能的政府债供给增加以及机构行为本身的波动性。整体而言，债市的下行风险或基本可控，预计依据市场行情和盈亏比水平进行适当的波段操作仍有改善组合收益的机会。

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，对基金所持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。日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会审核和决定投资资产估值的相关事务，确保基金估值的公允、合理，切实维护基金持有人利益。

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、本基金的基金合同等规定以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未实施利润分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同的规定实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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合规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在联博汇利债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，联博基金管理有限公司在联博汇利债券型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由联博基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关联博汇利债券型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：联博汇利债券型证券投资基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	2,137,861.74	1,733,454.07
结算备付金		33,188.31	32,999.98
存出保证金		—	—
交易性金融资产	6.4.7.2	200,115,008.75	186,881,726.10
其中：股票投资		23,732,276.97	23,240,034.20
基金投资		—	—
债券投资		176,382,731.78	163,641,691.90
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
其他投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	5,500,000.00	8,997,880.55
应收清算款		10,640,802.88	—
应收股利		—	—

应收申购款		1,037.97	200,049.60
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		218,427,899.65	197,846,110.30
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 06 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		2,269,945.27	10,871,079.82
应付管理人报酬		108,311.78	106,809.60
应付托管费		27,077.96	26,702.40
应付销售服务费		55,370.65	32,770.70
应付投资顾问费		-	-
应交税费		6,285.96	2,752.48
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	82,175.64	110,855.00
负债合计		2,549,167.26	11,150,970.00
净资产:			
实收基金	6.4.7.7	204,846,629.90	181,064,152.66
未分配利润	6.4.7.8	11,032,102.49	5,630,987.64
净资产合计		215,878,732.39	186,695,140.30
负债和净资产总计		218,427,899.65	197,846,110.30

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，联博汇利债券 A 基金份额净值 1.0573 元，基金份额总额 48,485,459.77 份；联博汇利债券 C 基金份额净值 1.0528 元，基金份额总额 156,361,170.13 份。联博汇利债券份额总额合计为 204,846,629.90 份。

6.2 利润表

会计主体：联博汇利债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 06 月 04 日（基金合同生效 日）至 2025 年 06 月 30 日
一、营业总收入		5,578,273.77	2,331,912.27
1. 利息收入		32,582.74	350,534.64

其中：存款利息收入	6.4.7.9	17,305.08	90,553.38
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		15,277.66	259,981.26
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		5,062,991.48	647,939.46
其中：股票投资收益	6.4.7.10	2,706,867.16	23,374.02
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	2,112,687.94	214,712.36
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	243,436.38	409,853.08
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	443,344.71	1,333,438.17
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	39,354.84	-
减：二、营业总支出		1,224,995.73	470,413.54
1. 管理人报酬		651,660.11	262,715.03
2. 托管费		162,915.01	65,678.74
3. 销售服务费		302,847.60	125,799.00
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		10,543.97	0.45
其中：卖出回购金融资产支出		10,543.97	0.45
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		3,053.40	1,101.87
8. 其他费用	6.4.7.19	93,975.64	15,118.45
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,353,278.04	1,861,498.73
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,353,278.04	1,861,498.73
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		4,353,278.04	1,861,498.73

注：本基金合同生效日为 2025 年 06 月 04 日，上年度可比期间为 2025 年 06 月 04 日至 2025 年 06 月 30 日。

6.3 净资产变动表

会计主体：联博汇利债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配	净资产合计

		利润	
一、上期期末净资产	181,064,152.66	5,630,987.64	186,695,140.30
二、本期期初净资产	181,064,152.66	5,630,987.64	186,695,140.30
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	23,782,477.24	5,401,114.85	29,183,592.09
（一）、综合收益总额	-	4,353,278.04	4,353,278.04
（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）	23,782,477.24	1,047,836.81	24,830,314.05
其中：1. 基金申购款	121,161,172.44	4,754,812.39	125,915,984.83
2. 基金赎回款	-97,378,695.20	-3,706,975.58	-101,085,670.78
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	204,846,629.90	11,032,102.49	215,878,732.39
项目	上年度可比期间 2025 年 06 月 04 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	614,000,189.93	-	614,000,189.93
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	1,861,498.73	1,861,498.73
（一）、综合收益总额	-	1,861,498.73	1,861,498.73
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	614,000,189.93	1,861,498.73	615,861,688.66

注：本基金合同生效日为 2025 年 06 月 04 日，上年度可比期间为 2025 年 06 月 04 日至 2025 年 06 月 30 日。

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：

罗登攀

Bing Li

龚黎

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

联博汇利债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2024]第 1837 号《关于准予联博汇利债券型证券投资基金注册的批复》注册，由联博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《联博汇利债券型证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 613,786,612.54 元。经向中国证监会备案，《联博汇利债券型证券投资基金基金合同》于 2025 年 06 月 04 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 614,000,189.93 份基金份额，其中认购资金利息折合 213,577.39 份基金份额。本基金的基金管理人为联博基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《联博汇利债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、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》及其配套规则和《联博汇利债券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债券（包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、中期票据、地方政府债、次级债、政府支持债券、政府支持机构债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款及其他银行存款等）、现金等货币市场工具、国债期货、信用衍生品、股票（包括主板、科创板、创业板以及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、存托凭证、经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金（仅包含全市场的境内股票型 ETF 及本基金管理人管理的股票型基金、计入权益类资产的混合型基金，不包含 QDII 基金、香港互认基金、货币市场基金、基金中基金和其他投资范围包含基金的基金）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）。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。本基金业绩比较基准为：中债新综合财富（总值）指数收益率 $\times$ 85%+中证 800 指数收益率 $\times$ 10%+1 年期定期存款利率（税后） $\times$ 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。

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 06 月 30 日的财务状况、自 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日止期间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，自 2026 年 1 月 1 日至 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 06 月 30 日
活期存款	553,108.05
等于：本金	552,541.66
加：应计利息	566.39
定期存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
其中：存款期限 1 个月以内	—
存款期限 1-3 个月	—
存款期限 3 个月以上	—
其他存款	1,584,753.69
等于：本金	1,584,616.21
加：应计利息	137.48
合计	2,137,861.74

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用资金账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 06 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		21,791,949.67	—	23,732,276.97	1,940,327.30
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—	—
债券	交易所市场	13,733,527.75	60,663.82	13,786,087.52	-8,104.05
	银行间市场	160,932,284.68	1,463,644.26	162,596,644.26	200,715.32
	合计	174,665,812.43	1,524,308.08	176,382,731.78	192,611.27
资产支持证券		—	—	—	—
基金		—	—	—	—
其他		—	—	—	—
合计		196,457,762.10	1,524,308.08	200,115,008.75	2,132,938.57

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。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

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 06 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	5,500,000.00	—
银行间市场	—	—
合计	5,500,000.00	—

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	6,800.00
其中：交易所市场	—
银行间市场	6,800.00
应付利息	—
应付审计费	15,868.27
应付信息披露费	59,507.37
合计	82,175.64

6.4.7.7 实收基金

联博汇利债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	99,451,040.56	99,451,040.56
本期申购	1,640,490.69	1,640,490.69
本期赎回（以“-”号填列）	-52,606,071.48	-52,606,071.48
本期末	48,485,459.77	48,485,459.77

联博汇利债券 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	81,613,112.10	81,613,112.10
本期申购	119,520,681.75	119,520,681.75
本期赎回（以“-”号填列）	-44,772,623.72	-44,772,623.72
本期末	156,361,170.13	156,361,170.13

注：申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

联博汇利债券 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,516,252.36	-317,154.12	3,199,098.24
本期期初	3,516,252.36	-317,154.12	3,199,098.24
本期利润	1,333,256.35	227,982.97	1,561,239.32
本期基金份额交易产生的变动数	-2,112,602.49	130,778.64	-1,981,823.85
其中：基金申购款	84,614.11	-2,136.33	82,477.78
基金赎回款	-2,197,216.60	132,914.97	-2,064,301.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,736,906.22	41,607.49	2,778,513.71

联博汇利债券 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,691,078.76	-259,189.36	2,431,889.40
本期期初	2,691,078.76	-259,189.36	2,431,889.40
本期利润	2,576,676.98	215,361.74	2,792,038.72
本期基金份额交易产生的变动数	2,852,899.50	176,761.16	3,029,660.66
其中：基金申购款	4,726,340.05	-54,005.44	4,672,334.61
基金赎回款	-1,873,440.55	230,766.60	-1,642,673.95
本期已分配利润	-	-	-

本期末	8,120,655.24	132,933.54	8,253,588.78
-----	--------------	------------	--------------

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	14,324.76
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	2,791.99
结算备付金利息收入	188.33
其他	-
合计	17,305.08

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用资金账户的证券交易结算资金产生的利息收入，其他为申购款利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益—买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	59,666,191.05
减：卖出股票成本总额	56,868,090.32
减：交易费用	91,233.57
买卖股票差价收入	2,706,867.16

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01月01日至2026年06月30日
债券投资收益—利息收入	1,903,445.90
债券投资收益—买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入	209,242.04
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	2,112,687.94

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01月01日至2026年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	524,306,641.52
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	520,191,899.67
减：应计利息总额	3,891,725.86
减：交易费用	13,773.95
买卖债券差价收入	209,242.04

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项目构成

本基金在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 贵金属投资收益项目构成

本基金在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

本基金在本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	243,436.38
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	243,436.38

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01月01日至2026年06月30日
1. 交易性金融资产	443,344.71
— 股票投资	90,619.44
— 债券投资	352,725.27
— 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	443,344.71

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	39,354.84
合计	39,354.84

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，收取的赎回费全额计入基金资产。

6.4.7.18 信用减值损失

本基金在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 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
审计费用	15,868.27
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	93,975.64

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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明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
联博基金管理有限公司（“联博基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、基金销售机构

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

本基金在本报告期内与上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期内与上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金在本报告期内与上年度可比期间均没有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 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 06 月 04 日（基 金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	651,660.11	262,715.03
其中：应支付销售机构的客户维护费	319,042.28	131,357.12
应支付基金管理人的净管理费	332,617.83	131,357.91

注：支付基金管理人联博基金管理有限公司的管理费按前一日基金资产净值 0.60% 的年费率计提，

逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理费 = 前一日基金资产净值 × 0.60% / 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 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 06 月 04 日（基金 合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日
----	---	---

当期发生的基金应支付的托管费	162,915.01	65,678.74
----------------	------------	-----------

注：支付基金托管人交通银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 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 × 0.15% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	联博汇利债券 A	联博汇利债券 C	合计
联博基金管理有限公司	—	526.94	526.94
交通银行股份有限公司	—	301,512.38	301,512.38
合计	—	302,039.32	302,039.32
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 06 月 04 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	联博汇利债券 A	联博汇利债券 C	合计
交通银行股份有限公司	—	125,798.48	125,798.48
合计	—	125,798.48	125,798.48

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额对应的基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给联博基金管理有限公司，再由联博基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 × 0.40% / 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

本基金本报告期内与上年度可比期间均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

本基金本报告期内与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

本基金本报告期内与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

联博汇利债券 C

份额单位：份

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 06 月 04 日（基金 合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日
基金合同生效日（2025 年 06 月 04 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	255,699.83	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	255,699.83	-
报告期末持有的基金份额占基金总 份额比例	0.16%	-

注：1、期间申购/买入总份额含转换入、红利再投、强制调增份额，期间赎回/卖出总份额含转换出、强制调减份额。

- 2、本基金的基金管理人运用固有资金投资本基金费率按法律文件公布的费率执行。
- 3、本报告期内与上年度可比期间，本基金的基金管理人未运用固有资金投资联博汇利债券 A。
- 4、本基金“报告期末持有的基金份额占基金总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例。

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除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 06 月 04 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股 份有限公司	553,108.05	14,324.76	36,320,032.79	70,242.86

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行股份有限公司保管，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

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金在本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 06 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
001248	华润新能源	2026 年 06 月 25 日	1 个月以内（含）	新股未上市	10.11	10.11	500	5,055.00	5,055.00	—

注：根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票及创业板股票需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

于 2026 年 06 月 30 日，本基金持有的流通受限证券为参与网上认购新发的股票，股票自上市之日起可自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	-------	------	--------	-------	--------	--------	----

				价						
688072	拓荆科技	2026 年 06 月 29 日	重大事项停牌	832.00	2026 年 07 月 13 日	890.99	200	133,009.00	166,400.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

于 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的银行间债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的交易所债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了分工明确、相互制约的风险管理组织架构体系。公司的风险管理组织架构体系由公司董事会、监事会、董事会风险控制委员会、公司管理层及其风险管理委员会、督察长、风控部、监察稽核部以及各个业务部门和全体员工共同组成。

董事会负责确定公司风险管理总体目标，制定公司风险管理战略和风险应对策略，审议重大事件、重大决策的风险评估，审批重大风险解决方案，批准公司基本风险管理制度，对维持有效的公司风险管理框架承担最终责任。董事会下设风险控制委员会，负责审查公司监察稽核、风险管理工作情况，负责对公司合规管理制度、风险管理制度的执行情况进行监督。公司管理层负责风险管理制度的制定，在董事会授权范围内审批重大事件的风险评估意见和解决方案，组织各部门实施风险解决方案和开展风险管理工作，对有效的风险管理承担直接责任。公司管理层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。督察长通过监察稽核部和风控部对风险控制措施的执行情况进行监督，并对各个部门和员工实施的相关制度和控制措施提出建议。风控部负责就风险问题提供指导和建议，负责评估、监控、检查和报告公司风险管理状况，执行公司的风险管理战略和决策，定性和定量评估风险。公司各业务部门负责贯彻落实公司的风险管理措施，定期对本部门的风险进行全面评估，并对本部门风险控制的有效性负责。公司所有员工是本岗位风险控制的

直接责任人，负责具体风险管理职责的实施。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去评估各种风险可能产生的损失。从定性的角度出发，根据每个基金的投资目标，确定组合的相关风险收益特征，确保基金的风险收益特征与基金投资策略相适配；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、日常量化报告，以及对各种风险量化指标进行监督、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。本基金的银行存款以活期存款方式存放在本基金的托管人，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以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	—	—
A-1 以下	—	—
未评级	40,262,720.55	48,454,229.04
合计	40,262,720.55	48,454,229.04

注：未评级债券为短期融资券、超短期融资券。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末	上年度末
--------	-----	------

	2026 年 06 月 30 日	2025 年 12 月 31 日
AAA	112,318,241.64	50,627,190.14
AAA 以下	—	—
未评级	23,801,769.59	64,560,272.72
合计	136,120,011.23	115,187,462.86

注：未评级债券为国债、政策性金融债。

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于约定开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

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》且于基金开放期内按照《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，通过独立的风控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%。

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

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

本基金本报告期末无重大流动性风险（上年末：同）。

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。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 06 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	2,137,861.74	-	-	-	2,137,861.74
结算备付金	33,188.31	-	-	-	33,188.31
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	123,745,091.46	22,645,930.69	29,991,709.63	23,732,276.97	200,115,008.75
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资	5,500,000.00	-	-	-	5,500,000.00

产					
应收清算款	-	-	-	10,640,802.88	10,640,802.88
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,037.97	1,037.97
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	131,416,141.51	22,645,930.69	29,991,709.63	34,374,117.82	218,427,899.65
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	2,269,945.27	2,269,945.27
应付管理人报酬	-	-	-	108,311.78	108,311.78
应付托管费	-	-	-	27,077.96	27,077.96
应付销售服务费	-	-	-	55,370.65	55,370.65
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	6,285.96	6,285.96
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	82,175.64	82,175.64
负债总计	-	-	-	2,549,167.26	2,549,167.26
利率敏感度缺口	131,416,141.51	22,645,930.69	29,991,709.63	31,824,950.56	215,878,732.39
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	1,733,454.07	-	-	-	1,733,454.07
结算备付金	32,999.98	-	-	-	32,999.98
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	58,547,534.25	71,484,501.37	33,609,656.28	23,240,034.20	186,881,726.10
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	8,997,880.55	-	-	-	8,997,880.55
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	200,049.60	200,049.60
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	69,311,868.85	71,484,501.37	33,609,656.28	23,440,083.80	197,846,110.30
负债					

短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	10,871,079.82	10,871,079.82
应付管理人报酬	-	-	-	106,809.60	106,809.60
应付托管费	-	-	-	26,702.40	26,702.40
应付销售服务费	-	-	-	32,770.70	32,770.70
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	2,752.48	2,752.48
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	110,855.00	110,855.00
负债总计	-	-	-	11,150,970.00	11,150,970.00
利率敏感度缺口	69,311,868.85	71,484,501.37	33,609,656.28	12,289,113.80	186,695,140.30

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	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 06 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	897,203.17	938,500.44
	市场利率上升 25 个基点	-881,616.42	-926,374.42

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。

本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；投资于股票、存托凭证、股票型基金、混合型基金等权益类资产及可转换债券、分离交易可转债（分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券的比例合计不超过基金资产的 20%；每个交易日日终，在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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，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 06 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	23,732,276.97	10.99	23,240,034.20	12.45
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	23,732,276.97	10.99	23,240,034.20	12.45

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2026 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 10.99%（2025 年 12 月 31 日：12.45%），因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响（2025 年 12 月 31 日：同）。

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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入

值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：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 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	23,560,821.97	23,240,034.20
第二层次	176,554,186.78	163,641,691.90
第三层次	-	-
合计	200,115,008.75	186,881,726.10

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可转换债券等，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会将相关股票和可转换债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，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

于本报告期间，本基金无公允价值所属层次间的重大变动。

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工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2026 年 06 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 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	23,732,276.97	10.87
	其中：股票	23,732,276.97	10.87
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	176,382,731.78	80.75
	其中：债券	176,382,731.78	80.75
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	5,500,000.00	2.52
	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	2,171,050.05	0.99
8	其他各项资产	10,641,840.85	4.87
9	合计	218,427,899.65	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,109,627.00	0.51
C	制造业	15,548,918.97	7.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	187,444.00	0.09
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	106,713.00	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	594,134.00	0.28
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,487,751.00	0.69
J	金融业	3,587,704.00	1.66
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	1,109,985.00	0.51
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	23,732,276.97	10.99

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	300308	中际旭创	1,000	1,270,000.00	0.59
2	300750	宁德时代	2,300	903,923.00	0.42
3	603259	药明康德	6,900	859,119.00	0.40
4	688256	寒武纪	400	638,220.00	0.30
5	002142	宁波银行	21,000	623,490.00	0.29
6	601398	工商银行	88,100	622,867.00	0.29
7	688002	睿创微纳	3,613	558,894.97	0.26
8	688008	澜起科技	1,736	537,986.40	0.25
9	000100	TCL 科技	87,400	508,668.00	0.24
10	600352	浙江龙盛	39,900	483,189.00	0.22
11	603345	安井食品	6,000	481,140.00	0.22
12	000338	潍柴动力	17,000	463,250.00	0.21
13	601899	紫金矿业	17,500	439,950.00	0.20
14	000725	京东方 A	50,000	434,000.00	0.20
15	600183	生益科技	2,500	433,500.00	0.20
16	600030	中信证券	15,000	430,950.00	0.20
17	300033	同花顺	1,740	419,340.00	0.19
18	688521	芯原股份	1,100	408,254.00	0.19
19	688017	绿的谐波	900	376,074.00	0.17
20	601009	南京银行	37,900	374,831.00	0.17
21	002916	深南电路	800	366,320.00	0.17
22	002603	以岭药业	23,100	346,500.00	0.16
23	600487	亨通光电	3,100	338,954.00	0.16
24	600176	中国巨石	4,400	320,672.00	0.15
25	600060	海信视像	11,000	306,570.00	0.14
26	000951	中国重汽	15,700	306,307.00	0.14
27	600741	华域汽车	19,500	302,640.00	0.14

28	000708	中信特钢	23,700	299,094.00	0.14
29	600919	江苏银行	26,800	288,904.00	0.13
30	000739	普洛药业	17,300	288,218.00	0.13
31	600522	中天科技	4,700	285,196.00	0.13
32	301308	江波龙	400	281,520.00	0.13
33	002008	大族激光	1,800	270,198.00	0.13
34	688347	华虹宏力	800	269,040.00	0.12
35	601919	中远海控	19,700	261,222.00	0.12
36	600132	重庆啤酒	6,300	260,190.00	0.12
37	300373	扬杰科技	1,600	251,568.00	0.12
38	300012	华测检测	18,100	250,866.00	0.12
39	600546	山煤国际	22,500	245,925.00	0.11
40	601168	西部矿业	8,900	241,546.00	0.11
41	000776	广发证券	10,300	241,020.00	0.11
42	601717	中创智领	17,300	240,643.00	0.11
43	000157	中联重科	34,200	238,374.00	0.11
44	600584	长电科技	2,300	238,165.00	0.11
45	688702	盛科通信	600	233,994.00	0.11
46	300408	三环集团	1,400	233,660.00	0.11
47	601138	工业富联	3,200	230,880.00	0.11
48	600166	福田汽车	74,700	217,377.00	0.10
49	601998	中信银行	31,100	215,523.00	0.10
50	002156	通富微电	2,700	204,849.00	0.09
51	002271	东方雨虹	17,000	201,790.00	0.09
52	002001	新和成	7,100	201,782.00	0.09
53	600018	上港集团	37,600	177,472.00	0.08
54	601688	华泰证券	8,200	169,084.00	0.08
55	688072	拓荆科技	200	166,400.00	0.08
56	688396	华润微	1,700	165,835.00	0.08
57	001872	招商港口	8,000	155,440.00	0.07
58	688200	华峰测控	296	155,429.60	0.07
59	600989	宝丰能源	7,500	152,475.00	0.07
60	000729	燕京啤酒	14,600	147,898.00	0.07
61	603444	吉比特	400	143,368.00	0.07
62	002384	东山精密	500	131,175.00	0.06
63	688361	中科飞测	300	129,000.00	0.06
64	002128	电投能源	5,300	122,536.00	0.06
65	300136	信维通信	1,000	119,250.00	0.06
66	688009	中国通号	24,100	114,716.00	0.05
67	002532	天山铝业	10,500	112,665.00	0.05
68	601077	渝农商行	17,900	109,369.00	0.05

69	601869	长飞光纤	200	109,180.00	0.05
70	603233	大参林	7,100	106,713.00	0.05
71	600098	广州发展	17,100	101,061.00	0.05
72	688525	佰维存储	200	98,946.00	0.05
73	600801	华新建材	6,200	96,720.00	0.04
74	601577	长沙银行	10,600	92,326.00	0.04
75	603799	华友钴业	1,800	86,868.00	0.04
76	600362	江西铜业	2,000	86,600.00	0.04
76	601233	桐昆股份	4,000	86,600.00	0.04
78	603308	应流股份	1,400	84,560.00	0.04
79	600008	首创环保	29,900	81,328.00	0.04
80	688331	荣昌生物	600	78,156.00	0.04
81	600566	济川药业	3,500	77,665.00	0.04
82	601600	中国铝业	8,900	73,158.00	0.03
83	300628	亿联网络	2,100	71,022.00	0.03
84	688301	奕瑞科技	560	69,440.00	0.03
85	300450	先导智能	1,700	69,224.00	0.03
86	688111	金山办公	300	63,915.00	0.03
87	603993	洛阳钼业	3,400	59,670.00	0.03
88	000807	云铝股份	2,600	57,564.00	0.03
89	000933	神火股份	2,700	57,240.00	0.03
90	001248	华润新能源	500	5,055.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	300308	中际旭创	1,623,870.00	0.87
2	603259	药明康德	1,412,026.80	0.76
3	300750	宁德时代	1,048,515.00	0.56
4	600919	江苏银行	1,027,205.00	0.55
5	000338	潍柴动力	985,073.00	0.53
6	688256	寒武纪	969,720.63	0.52
7	688008	澜起科技	962,276.75	0.52
8	300033	同花顺	880,253.00	0.47
9	600352	浙江龙盛	828,744.00	0.44
10	601857	中国石油	814,020.00	0.44
11	603345	安井食品	781,741.00	0.42
12	002056	横店东磁	773,760.00	0.41
13	601899	紫金矿业	738,265.00	0.40

14	601398	工商银行	712,846.00	0.38
15	600690	海尔智家	673,024.00	0.36
16	002142	宁波银行	669,203.00	0.36
17	600009	上海机场	656,611.00	0.35
18	603799	华友钴业	651,059.00	0.35
19	002916	深南电路	640,748.00	0.34
20	600219	南山铝业	634,314.00	0.34

注：买入金额均按买入成交金额（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	300308	中际旭创	1,370,599.00	0.73
2	000338	潍柴动力	1,180,621.00	0.63
3	002056	横店东磁	1,124,681.00	0.60
4	300750	宁德时代	1,120,725.00	0.60
5	600919	江苏银行	1,055,519.00	0.57
6	002916	深南电路	900,333.00	0.48
7	601857	中国石油	890,755.00	0.48
8	600873	梅花生物	878,053.00	0.47
9	600219	南山铝业	856,119.00	0.46
10	300408	三环集团	853,137.87	0.46
11	002555	三七互娱	850,334.00	0.46
12	600183	生益科技	842,672.00	0.45
13	000333	美的集团	821,976.00	0.44
14	688008	澜起科技	814,682.92	0.44
15	601319	中国人保	779,856.00	0.42
16	002028	思源电气	769,976.00	0.41
17	601899	紫金矿业	758,899.00	0.41
18	002236	大华股份	724,938.00	0.39
19	000776	广发证券	722,675.00	0.39
20	002142	宁波银行	707,399.00	0.38

注：卖出金额均按卖出成交金额（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	57,269,713.65
卖出股票收入（成交）总额	59,666,191.05

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	13,786,087.52	6.39
2	央行票据	—	—
3	金融债券	60,846,591.66	28.19
	其中: 政策性金融债	40,401,846.45	18.72
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	40,262,720.55	18.65
6	中期票据	61,487,332.05	28.48
7	可转债 (可交换债)	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	176,382,731.78	81.70

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	102483276	24 中石化 MTN001	100,000	10,365,471.23	4.80
2	102102068	21 中国旅游 MTN001	100,000	10,314,994.52	4.78
3	102381905	23 首钢 MTN004	100,000	10,289,484.38	4.77
4	102585356	25 电网 MTN043	100,000	10,268,179.73	4.76
5	252380004	23 信达金融债 01	100,000	10,259,427.40	4.75

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

根据本基金合同规定, 本基金不参与股指期货交易。

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

本基金投资国债期货将以套期保值为目的，根据风险管理的原则，充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，主要选择流动性好、交易活跃的国债期货合约进行交易，以对冲投资组合的利率风险、降低调仓过程中的冲击成本等。在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资前十名证券的发行主体本期被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚说明

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国工商银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到监管部门处罚或采取行政监管措施。

本基金对上述主体所发行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。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同约定备选库之外的股票。

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	10,640,802.88
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	1,037.97
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	10,641,840.85

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

本基金本报告期末持有的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

由于四舍五入原因，投资组合报告中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
联博汇利债券 A	146	332,092.19	10,092,628.92	20.82%	38,392,830.85	79.18%
联博汇利债券 C	179	873,526.09	542,348.02	0.35%	155,818,822.11	99.65%
合计	325	630,297.32	10,634,976.94	5.19%	194,211,652.96	94.81%

注：1、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）。

2、户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	联博汇利债券 A	537,188.93	1.11%
	联博汇利债券 C	609,155.19	0.39%
	合计	1,146,344.12	0.56%

注：本表列示“占基金总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例；对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
	联博汇利债券 A	0

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	联博汇利债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	联博汇利债券 A	10~50
	联博汇利债券 C	0~10
	合计	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	联博汇利债券 A	联博汇利债券 C
基金合同生效日（2025 年 06 月 04 日）基金份额总额	172,969,593.13	441,030,596.80
本报告期期初基金份额总额	99,451,040.56	81,613,112.10
本报告期基金总申购份额	1,640,490.69	119,520,681.75
减：本报告期基金总赎回份额	52,606,071.48	44,772,623.72
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	48,485,459.77	156,361,170.13

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

本报告期内，基金管理人的重大人事变动情况如下：

2026 年 3 月 26 日，AJAI MOHAN KAUL 先生离任公司董事长，MICHAEL FRAZIER THOMPSON 先生新任前述职务。

自 2026 年 6 月 29 日起，王玲女士担任公司督察长，总经理罗登攀先生不再代行督察长职务。

本基金管理人已在规定的信息披露媒介登载了以上重大人事变动公告。上述变更事项已按有关规定向监管机构报备。

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

本报告期内，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及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，本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人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，本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

本报告期内，基金托管人的托管业务部门未受到调查或处罚等情况。

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，基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚等情况。

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	
中国国际 金融	2	116,935,904.70	100.00%	54,028.60	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）而支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

2. 根据《关于新设公募基金管理人证券交易模式转换有关事项的通知》（证监办发[2019]14 号）及《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（证监会公告[2024]3 号）的有关规定，基金产品管理人可选择一家或多家证券公司开展证券交易，并可免于执行相关分仓规定。

3. 本基金管理人选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强，

- 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。
5. 本基金本报告期内证券经纪商无变更。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中国国际金融	128,084,626.04	100.00%	270,200,000.00	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	联博基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2026年01月01日
2	联博汇利债券型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2026年01月21日
3	联博基金管理有限公司旗下基金 2025 年第四季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2026年01月21日
4	联博基金管理有限公司董事长变更公告	中国证监会规定媒介	2026年03月28日
5	联博汇利债券型证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会规定媒介	2026年03月30日
6	联博基金管理有限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03月30日
7	联博基金管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2026年03月30日
8	联博汇利债券型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2026年04月21日
9	联博基金管理有限公司旗下基金 2026 年第一季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2026年04月21日
10	2025 年度联博基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	中国证监会规定媒介	2026年04月29日
11	联博汇利债券型证券投资基金基金经理	中国证监会规定媒介	2026年04月29日

	变更公告		
12	联博汇利债券型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2026年04月30日
13	联博汇利债券型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2026年04月30日
14	联博汇利债券型证券投资基金更新招募说明书（2026 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2026年04月30日
15	联博汇利债券型证券投资基金更新招募说明书和基金产品资料概要提示性公告	中国证监会规定媒介	2026年04月30日
16	关于警惕冒用联博基金管理有限公司名义进行诈骗活动的特别提示公告	中国证监会规定媒介	2026年05月18日
17	联博汇利债券型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2026年05月22日
18	联博汇利债券型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2026年05月22日
19	联博汇利债券型证券投资基金更新招募说明书（2026 年第 2 号）	中国证监会规定媒介	2026年05月22日
20	联博基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金更新招募说明书和基金产品资料概要的提示性公告	中国证监会规定媒介	2026年05月22日
21	联博基金管理有限公司关于增加注册资本的公告	中国证监会规定媒介	2026年05月28日
22	联博基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2026年06月30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

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
个人	1	20260213-20260630	-	111,665,871.65	-	111,665,871.65	54.51%
产品特有风险							
本基金本报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20%的情况，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，存在基金资产无法以合理价格及时变现以支付投资者赎回款的风险，以及基金份额净值出现大幅波动的风险。							

注：申购份额含红利再投、转换入份额、因份额拆分而增加的份额。赎回份额含转换出份额、因份

额合并而减少的份额。

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、中国证监会批准本基金募集的文件
- 2、本基金的《基金合同》
- 3、本基金的《托管协议》
- 4、本基金的《招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本基金在规定媒介披露的各项公告
- 7、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人办公场所及基金托管人住所

12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站 <https://www.alliancebernstein.com.cn/> 查阅。

联博基金管理有限公司

2026 年 08 月 28 日