

华宝量化对冲策略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：中国银行股份有限公司

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，并由董事长签发。

基金托管人中国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	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
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	53

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	54
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	54
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	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12 市场中性策略执行情况	54
7.13 投资组合报告附注	55
§ 8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 盈利投资者数量占比	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
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	56
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况	56
§ 9 开放式基金份额变动	57
§ 10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
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	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4 基金投资策略的改变	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	57
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	58
10.8 其他重大事件	62
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	63
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	63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	63
§ 12 备查文件目录	63
12.1 备查文件目录	63
12.2 存放地点	63
12.3 查阅方式	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金		
基金简称	华宝量化对冲混合		
基金主代码	000753		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2014 年 9 月 17 日		
基金管理人	华宝基金管理有限公司		
基金托管人	中国银行股份有限公司		
报告期末基金份 额总额	753,111,844.41 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基 金简称	华宝量化对冲混合 A	华宝量化对冲混合 C	华宝量化对冲混合 D
下属分级基金的交 易代码	000753	000754	021381
报告期末下属分级 基金的份额总额	149,757,999.46 份	132,744,796.41 份	470,609,048.54 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险的基础上，运用股指期货等衍生工具对冲市场系统风险，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	在资产配置方面，本基金主要运用股指期货等空头工具对持有的股票等权益类多头组合进行对冲操作，规避权益类多头组合的市场系统性风险；同时预留必要的现金，以应对保证金的增加要求或投资者的赎回申请。股票方面，本基金主要采用量化行业配置模型和量化 Alpha 选股模型构建指数增强股票组合，严格控制运作风险，并根据市场变化趋势，定期对模型进行调整，以改进模型的有效性，最大化超额收益。
业绩比较基准	一年期银行定期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为特殊类型的混合型基金，主要采用追求绝对收益的市场中性策略，与股票市场表现的相关性较低。相对股票型基金和一般的混合型基金，其预期风险较小。本基金实际的收益和风险主要取决于基金投资策略的有效性，因此收益不一定能超越业绩比较基准。

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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周雷	许俊
	联系电话	021-38505888	010-66596688
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400-700-5588、400-820-5050	95566
传真		021-38505777	010-66594942
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世	北京市西城区复兴门内大街 1 号

	纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	
办公地址	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	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	200120	100818
法定代表人	夏雪松	葛海蛟

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.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住所。

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)		
	华宝量化对冲混合 A	华宝量化对冲混合 C	华宝量化对冲混合 D
本期已实现 收益	13,439,386.14	9,117,862.14	5,569,656.78
本期利润	4,224,076.55	2,250,464.01	189,621.87
加权平均基 金份额本期 利润	0.0216	0.0133	0.0014
本期加权平 均净值利润 率	1.82%	1.16%	0.12%
本期基金份 额净值增长 率	1.37%	1.17%	1.27%

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	28,868,065.41	19,832,597.72	88,483,192.33
期末可供分配基金份额利润	0.1928	0.1494	0.1880
期末基金资产净值	178,626,064.87	152,577,394.13	559,092,240.87
期末基金份额净值	1.1928	1.1494	1.1880
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	46.56%	41.27%	2.49%

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

华宝量化对冲混合 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	0.17%	0.16%	0.37%	0.00%	-0.20%	0.16%
过去六个月	1.37%	0.18%	0.74%	0.01%	0.63%	0.17%
过去一年	2.18%	0.17%	1.50%	0.00%	0.68%	0.17%
过去三年	6.71%	0.24%	4.50%	0.00%	2.21%	0.24%

过去五年	1.02%	0.25%	7.50%	0.00%	-6.48%	0.25%
过去七年	17.44%	0.25%	10.50%	0.00%	6.94%	0.25%
过去十年	25.29%	0.23%	15.00%	0.00%	10.29%	0.23%
自基金合同 生效起至今	46.56%	0.26%	18.71%	0.01%	27.85%	0.25%

华宝量化对冲混合 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	0.07%	0.16%	0.37%	0.00%	-0.30%	0.16%
过去六个月	1.17%	0.18%	0.74%	0.01%	0.43%	0.17%
过去一年	1.78%	0.17%	1.50%	0.00%	0.28%	0.17%
过去三年	5.43%	0.24%	4.50%	0.00%	0.93%	0.24%
过去五年	-0.99%	0.25%	7.50%	0.00%	-8.49%	0.25%
过去七年	14.19%	0.25%	10.50%	0.00%	3.69%	0.25%
过去十年	21.53%	0.23%	15.00%	0.00%	6.53%	0.23%
自基金合同 生效起至今	41.27%	0.26%	18.71%	0.01%	22.56%	0.25%

华宝量化对冲混合 D

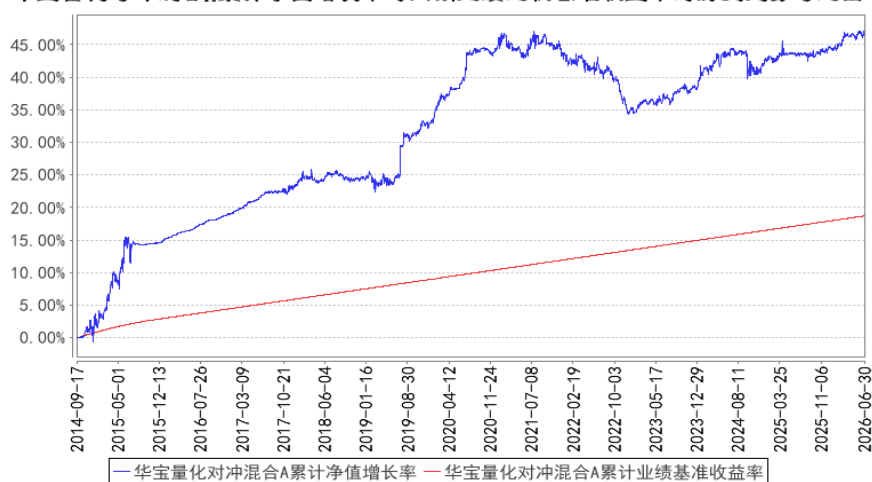
阶段	份额净值增 长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.12%	0.16%	0.37%	0.00%	-0.25%	0.16%
过去六个月	1.27%	0.18%	0.74%	0.01%	0.53%	0.17%
过去一年	1.97%	0.17%	1.50%	0.00%	0.47%	0.17%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同 生效起至今	2.49%	0.25%	3.26%	0.00%	-0.77%	0.25%

注：（1）基金业绩基准：一年期银行定期存款利率（税后）；

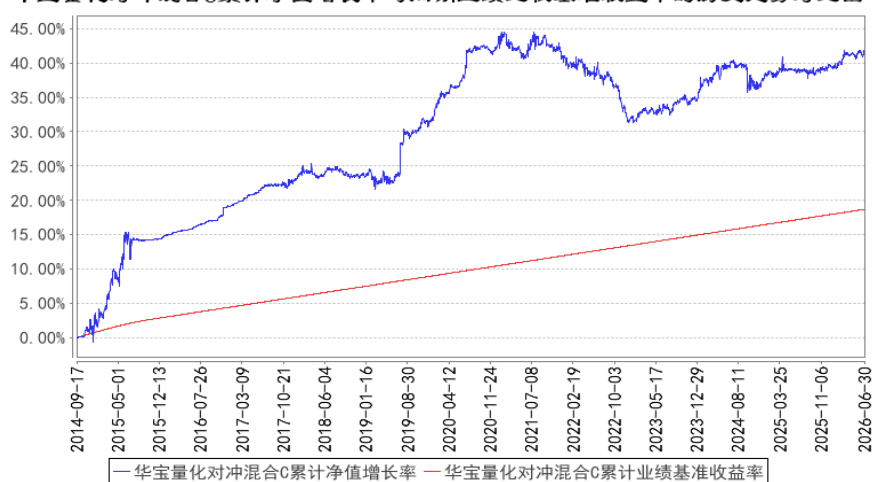
（2）净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

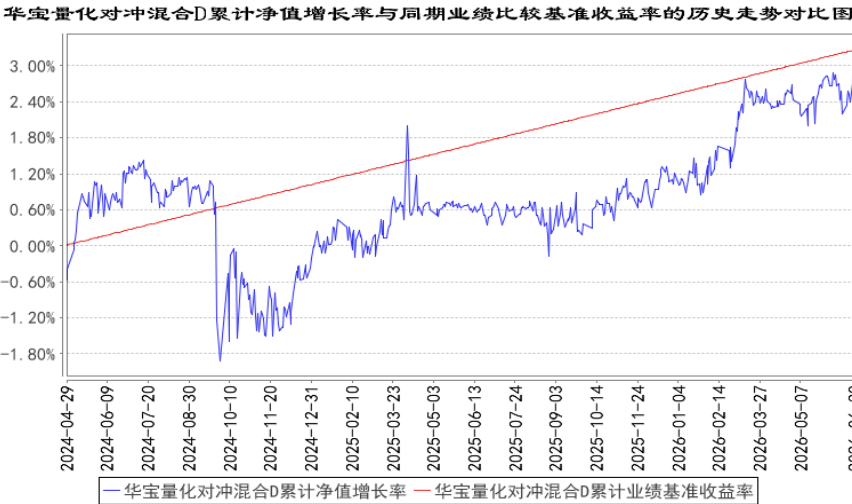
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华宝量化对冲混合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



华宝量化对冲混合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对比图





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 2015 年 03 月 17 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		
徐林明	本基金基金经理、量化投资总监、量化投资部总	2014-09-17	-	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

	经理				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。
王正	本基金经理	2020-01-02	-	14 年	硕士。2012 年 7 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任助理量化分析师、分析师、基金经理助理等职务。2020 年 1 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，2020 年 1 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，2021 年 1 月至 2022 年 7 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，2021 年 1 月至 2024 年 7 月任华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 1 月至 2022 年 8 月任华宝智慧产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 6 月至 2023 年 3 月任华宝安盈混合型证券投资基金基金经理，2025 年 8 月起任华宝创业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，2025 年 8 月起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、华宝科技先锋混合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，2026 年 6 月起任华宝创业板综合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（原：华宝创业板综指增强型发起式证券投资基金）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、《华宝量化对冲策略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

2026 年上半年，全球宏观呈现地缘冲突持续、货币政策预期扰动、资产走势分化的特征。一季度中东局势升级引发霍尔木兹海峡航运受阻，国际油价暴涨推升全球通胀粘性，美联储降息预期全面后移，全球金融条件骤然趋紧。二季度美伊关系出现和解迹象，原油快速回落。全球经济一季度受地缘冲击明显放缓，二季度在 AI 产业景气支撑下边际修复。大类资产走势分化，黄金丧失避险属性大幅回撤，美元指数在弱美元叙事与强现实之间反复博弈，美股韩股在 AI 产业周期推动下持续走强，市场波动率整体维持高位。国内经济展现总量稳健、结构分化、政策精准的运行特征，出口与生产端保持较强韧性，AI 相关产业成为主要增量来源，内需消费与投资偏弱。物价走势分化，PPI 受输入性因素影响有所冲高，CPI 则保持温和运行。整体看，中国经济在全球不确定性中凸显韧性，政策发力与产业升级为市场提供长期支撑。

股票市场方面，上半年 A 股呈现一季度防御避险、二季度科技突围的鲜明两段式行情，整体波动加剧、风格极致分化。报告期内沪深 300 指数累计上涨 7.55%，中证红利下跌 8.75%，科创 50 上涨 64.25%，创业板指上涨 35.58%，中证 2000 指数上涨 9.10%。行业层面，电子、通信涨幅居前，而周期及消费板块普遍承压，部分行业已回落至 924 前水平。上半年整体来看，A 股完成从红利防御到科技进攻的剧烈风格切换，结构性机会高度集中于 AI 产业链，传统顺周期板块持续承压，资金抱团效应及拥挤度指标达到历史极端水平。因子层面，行业中性视角下，上半年市场风格极端分化，成长、动量、超预期、大市值等因子较为强势，价值、红利、低波等走势偏弱，市场短期呈现高估值、高波动、高换手占优的异常格局，二季度 Alpha 环境相对不太友好。

本报告期，基金仍然坚持稳健的市场中性投资策略，利用股指期货对股票组合进行对冲，剥离系统性风险。期指基差水平仍然不够理想，季末各期指贴水幅度加深达到近年较极端的位置，基差波动加大。在此期间基金通过灵活的仓位管理和对冲工具的选择进行应对，实现了稳健的绝对收益。

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 1.37%，本报告期基金份额 C 类净值增长率为 1.17%，本报告期基金份额 D 类净值增长率为 1.27%；同期业绩比较基准收益率为 0.74%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年下半年，国际局势仍较为复杂，发达经济体增长放缓，下行风险仍存，贸易保护主义与地缘政治不确定性仍是主要威胁，但预计相比上半年的冲击反转和分化，下半年将进入风险与机会并存的格局。国内预计 GDP 增速保持稳定，政策重点从上半年的稳增长向促改革、扩内

需深化，消费提振与房地产企稳仍是关键抓手，在托底经济的同时持续培育新质生产力、推动产业结构转型升级。

从股票市场来看，上半年极致分化的市场环境在历史上极少持续超过 2 个季度，下半年市场风格有望迎来再平衡。经过二季度的科技抱团行情，AI 产业链部分标的估值已处于历史高位，资金拥挤度突破警戒阈值，短期波动风险加大；而周期、消费、红利等上半年持续承压的板块，估值已回落至历史低位，性价比优势逐步显现。随着基本面预期的修复和资金面的再配置，市场风格预计从高估值、高波动、高换手的极端状态向更加均衡的方向回归，成长与价值、大盘与小盘、科技与传统之间的剪刀差有望收敛。整体流动性仍较为充裕，投资者情绪在政策持续呵护下有望维持平稳，监管层引导上市公司提升质量、推动中长期资金入市等举措对市场长期健康发展起到积极作用。目前市场整体估值处于历史中等水平，未到泡沫区间，同时叠加基本面的持续改善与政策红利的逐步释放，A 股的长期战略配置价值仍然较高。

从长周期来看，在不确定的环境下，估值有安全边际、经营稳健、基本面优质、有核心竞争力的公司仍有较高的配置价值，有望取得长期稳定的相对收益。基金将继续关注符合常识和逻辑的因子，在投资过程中注重对个股基本面质地的考察，利用量化模型甄选出具备良好经营能力、估值与成长匹配的优质公司。同时基金仍将坚持市场中性投资策略，利用股指期货对股票组合进行对冲，剥离系统性风险，并严格控制各项风险敞口，为投资者提供较为稳健的收益。当前受限于期指的深度贴水对冲环境一般，未来基金会紧密跟踪各股指期货合约的基差水平并根据不同的对冲成本进行仓位的灵活调整。

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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华宝量化对冲策略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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华宝量化对冲策略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	上年度末
-----	-----	-----	------

		2026 年 6 月 30 日	2025 年 12 月 31 日
资 产:			
货币资金	6.4.7.1	1,466,830.99	2,009,120.95
结算备付金		67,108,505.99	69,573,807.48
存出保证金		56,639,830.63	38,257,985.68
交易性金融资产	6.4.7.2	584,994,779.80	384,111,034.26
其中：股票投资		538,511,202.54	351,857,048.68
基金投资		-	-
债券投资		46,483,577.26	32,253,985.58
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	175,007,864.94	39,500,493.97
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		-	621,760.55
应收股利		-	-
应收申购款		86,407,601.72	5,077,579.18
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		971,625,414.07	539,151,782.07
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		79,470,342.05	-
应付赎回款		512,106.97	2,902,123.54
应付管理人报酬		596,252.33	447,535.99
应付托管费		119,250.48	89,507.22
应付销售服务费		124,438.18	80,879.93
应付投资顾问费		-	-
应交税费		9,475.14	15.46
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	497,849.05	460,721.21

负债合计		81,329,714.20	3,980,783.35
净资产:			
实收基金	6.4.7.7	753,111,844.41	460,037,616.13
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	137,183,855.46	75,133,382.59
净资产合计		890,295,699.87	535,170,998.72
负债和净资产总计		971,625,414.07	539,151,782.07

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 753,111,844.41 份，其中华宝量化对冲混合 A 基金份额总额 149,757,999.46 份，基金份额净值 1.1928 元；华宝量化对冲混合 C 基金份额总额 132,744,796.41 份，基金份额净值 1.1494 元；华宝量化对冲混合 D 基金份额总额 470,609,048.54 份，基金份额净值 1.1880 元。

6.2 利润表

会计主体：华宝量化对冲策略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		10,780,853.00	9,832,605.20
1. 利息收入		1,271,248.12	1,487,579.36
其中：存款利息收入	6.4.7.9	449,623.15	791,458.47
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		821,624.97	696,120.89
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		30,202,750.29	37,868,462.49
其中：股票投资收益	6.4.7.10	30,624,985.98	22,205,723.43
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	239,523.38	199,345.62
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	-4,581,211.64	11,128,205.06
股利收益	6.4.7.15	3,919,452.57	4,335,188.38
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	-21, 462, 742. 63	-29, 778, 050. 18
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	769, 597. 22	254, 613. 53
减：二、营业总支出		4, 116, 690. 57	4, 542, 517. 84
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	2, 894, 255. 52	3, 186, 157. 93
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	578, 851. 08	637, 231. 61
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	538, 943. 47	574, 731. 33
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		1, 268. 45	40, 243. 63
8. 其他费用	6. 4. 7. 19	103, 372. 05	104, 153. 34
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6, 664, 162. 43	5, 290, 087. 36
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6, 664, 162. 43	5, 290, 087. 36
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		6, 664, 162. 43	5, 290, 087. 36

6.3 净资产变动表

会计主体：华宝量化对冲策略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	460, 037, 616. 13	-	75, 133, 382. 59	535, 170, 998. 72
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净	460, 037, 616. 13	-	75, 133, 382. 59	535, 170, 998. 72

资产				
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	293,074,228.28	-	62,050,472.87	355,124,701.15
（一）、综合收益总额	-	-	6,664,162.43	6,664,162.43
（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）	293,074,228.28	-	55,386,310.44	348,460,538.72
其中：1. 基金申购款	786,057,567.53	-	141,717,220.35	927,774,787.88
2. 基金赎回款	-492,983,339.25	-	-86,330,909.91	-579,314,249.16
（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	753,111,844.41	-	137,183,855.46	890,295,699.87
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	617,367,935.01	-	89,688,239.35	707,056,174.36
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	617,367,935.01	-	89,688,239.35	707,056,174.36
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-117,640,674.89	-	-12,256,731.59	-129,897,406.48

（一）、综合收益总额	-	-	5,290,087.36	5,290,087.36
（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）	-117,640,674.89	-	-17,546,818.95	-135,187,493.84
其中：1. 基金申购款	213,721,327.03	-	34,619,944.68	248,341,271.71
2. 基金赎回款	-331,362,001.92	-	-52,166,763.63	-383,528,765.55
（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	499,727,260.12	-	77,431,507.76	577,158,767.88

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：

向辉

基金管理人负责人

李孟恒

主管会计工作负责人

张幸骏

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金(原名为华宝兴业量化对冲策略混合型发起式证券投资基金，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[2014]第 737 号《关于核准华宝兴业量化对冲策略混合型发起式证券投资基金募集的批复》核准，由华宝基金管理有限公司(原华宝兴业基金管理有限公司，已于 2017 年 10 月 17 日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业量化对冲策略混合型发起式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 606,936,516.77 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(2014)第 536 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华宝兴业量化对冲策略混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2014 年 9 月 17 日生效,基金合同生效日的基金份额总额为 607,038,069.95 份基金份额(A 类基金份额 539,601,058.43 份,C 类基金份额 67,437,011.52 份),其中认购资金利息折合 101,553.18 份基金份额。本基金的基金管理人为华宝基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据经批准的《华宝兴业量化对冲策略混合型发起式证券投资基金基金合同》和《华宝兴业量化对冲策略混合型发起式证券投资基金招募说明书》的规定,本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别,即 A 类基金份额和 C 类基金份额。A 类基金份额在投资者认购/申购时收取认购/申购费,但不收取销售服务费;C 类基金份额不收取认购/申购费,而从本类别基金资产中计提销售服务费。A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码,分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。

根据《华宝基金管理有限公司关于华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金增加 D 类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告》,自 2024 年 4 月 26 日起,对本基金增加 D 类基金份额、更新基金管理人和基金托管人信息,并相应修改基金合同等法律文件相关条款。增加 D 类基金份额后,本基金将设 A 类基金份额、C 类基金份额和 D 类基金份额三个基金份额类别,各类基金份额将分别设置基金代码,分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。

根据《华宝基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》,华宝兴业量化对冲策略混合型发起式证券投资基金于 2017 年 12 月 30 日起更名为华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝量化对冲策略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(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、存托凭证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)。本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的比例范围在 80%-120%之间。其中:权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值及持有的其他可投资的权益类空头工具价值的合计值;权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及持有的其他可投资的权益类多头工具价值的合计值。每个交易日日终,持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的 95%。其中:有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等。在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,

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的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：一年期银行定期存款利率(税后)。

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 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	1,466,830.99
等于：本金	1,465,826.28
加：应计利息	1,004.71
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	1,466,830.99

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		517,006,067.08	-	538,511,202.54	21,505,135.46
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	46,044,039.54	445,377.26	46,483,577.26	-5,839.54
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	46,044,039.54	445,377.26	46,483,577.26	-5,839.54
资产支持证券		-	-	-	-

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	563,050,106.62	445,377.26	584,994,779.80	21,499,295.92

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-460,213,440.00	-	-	-
其中：股指期货投资	-460,213,440.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-460,213,440.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IF2607	IF2607	-123.00	-181,621,800.00	-3,947,160.00
IF2608	IF2608	-8.00	-11,710,080.00	-287,520.00
IF2609	IF2609	-60.00	-87,296,400.00	-2,869,560.00
IH2607	IH2607	-175.00	-155,116,500.00	-2,540,940.00
IH2608	IH2608	-7.00	-6,179,040.00	20,460.00
IH2609	IH2609	-26.00	-22,860,240.00	-976,680.00
IH2612	IH2612	-7.00	-6,087,480.00	-56,700.00
合计				-10,658,100.00
减：可抵销期货暂收款				-10,658,100.00
净额				0.00

注：（1）买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

（2）衍生金融资产项下的利率/权益/其他衍生工具为国债/股指/商品期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指/商品/国债期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指/商品/国债期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销

后的净额为 0。

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	175,007,864.94	-
银行间市场	-	-
合计	175,007,864.94	-

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	432.73
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	424,024.44
其中：交易所市场	424,024.44
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	73,391.88
合计	497,849.05

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

华宝量化对冲混合 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	175,112,564.80	175,112,564.80
本期申购	167,279,927.33	167,279,927.33
本期赎回（以“-”号填列）	-192,634,492.67	-192,634,492.67
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	149,757,999.46	149,757,999.46

华宝量化对冲混合 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	138,531,251.77	138,531,251.77
本期申购	125,442,515.63	125,442,515.63
本期赎回（以“-”号填列）	-131,228,970.99	-131,228,970.99
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	132,744,796.41	132,744,796.41

华宝量化对冲混合 D

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	146,393,799.56	146,393,799.56
本期申购	493,335,124.57	493,335,124.57
本期赎回（以“-”号填列）	-169,119,875.59	-169,119,875.59
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	470,609,048.54	470,609,048.54

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

华宝量化对冲混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	42,862,223.39	-11,926,477.24	30,935,746.15
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	42,862,223.39	-11,926,477.24	30,935,746.15
本期利润	13,439,386.14	-9,215,309.59	4,224,076.55
本期基金份额交易产生的变动数	-10,617,496.32	4,325,739.03	-6,291,757.29
其中：基金申购款	45,175,811.02	-14,772,446.37	30,403,364.65
基金赎回款	-55,793,307.34	19,098,185.40	-36,695,121.94
本期已分配利润	-	-	-

本期末	45,684,113.21	-16,816,047.80	28,868,065.41
-----	---------------	----------------	---------------

华宝量化对冲混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	28,333,851.56	-9,482,239.36	18,851,612.20
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	28,333,851.56	-9,482,239.36	18,851,612.20
本期利润	9,117,862.14	-6,867,398.13	2,250,464.01
本期基金份额交易产生的变动数	-2,874,159.97	1,604,681.48	-1,269,478.49
其中：基金申购款	29,674,792.36	-11,657,585.09	18,017,207.27
基金赎回款	-32,548,952.33	13,262,266.57	-19,286,685.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	34,577,553.73	-14,744,956.01	19,832,597.72

华宝量化对冲混合 D

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	35,329,670.84	-9,983,646.60	25,346,024.24
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	35,329,670.84	-9,983,646.60	25,346,024.24
本期利润	5,569,656.78	-5,380,034.91	189,621.87
本期基金份额交易产生的变动数	100,399,577.84	-37,452,031.62	62,947,546.22
其中：基金申购款	145,708,056.74	-52,411,408.31	93,296,648.43
基金赎回款	-45,308,478.90	14,959,376.69	-30,349,102.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	141,298,905.46	-52,815,713.13	88,483,192.33

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	15,036.37
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	434,443.89
其他	142.89
合计	449,623.15

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	838,788,796.15
减：卖出股票成本总额	806,822,802.43
减：交易费用	1,341,007.74
买卖股票差价收入	30,624,985.98

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	224,014.14
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	15,509.24
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	239,523.38

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	33,325,381.44
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	32,889,285.76
减：应计利息总额	420,586.44
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	15,509.24

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	-4,581,211.64

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	3,919,452.57
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	3,919,452.57

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	-13,246,430.18
股票投资	-13,215,667.94
债券投资	-30,762.24
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-8,216,312.45
权证投资	-
期货投资	-8,216,312.45
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	-21,462,742.63

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	768,723.95
基金转换费收入	873.27
合计	769,597.22

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	13,884.51
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	11,380.17
账户维护费	18,000.00
上清所 CFCA 证书服务费	600.00
合计	103,372.05

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
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	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

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未通过关联方交易单元进行交易。

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	2,894,255.52	3,186,157.93
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,049,820.25	1,270,304.63
应支付基金管理人的净管理费	1,844,435.27	1,915,853.30

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%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% / 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	578,851.08	637,231.61

注：支付基金托管人中国银行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			
	华宝量化对冲混合 A	华宝量化对冲混合 C	华宝量化对冲混合 D	合计
华宝基金	-	1,807.54	632.47	2,440.01
中国银行	-	57,969.70	-	57,969.70
合计	-	59,777.24	632.47	60,409.71
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			

	华宝量化对冲混 合 A	华宝量化对冲混 合 C	华宝量化对冲混 合 D	合计
华宝基金	-	2,350.53	171.34	2,521.87
中国银行	-	198,325.40	-	198,325.40
合计	-	200,675.93	171.34	200,847.27

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，D 类基金份额的销售服务费按前一日 D 类基金份额的基金资产净值的 0.2% 年费率计提。本基金各类基金份额销售服务费计提的计算方法如下：

C 类基金份额： $H=E\times 0.4\%\div \text{当年天数}$

D 类基金份额： $H=E\times 0.2\%\div \text{当年天数}$

H 为各类基金份额每日应计提的基金销售服务费，E 为各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

本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人外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		上年度可比期间	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	1,466,830.99	15,036.37	4,520,012.55	10,631.08

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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无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
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股锁定	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定	53.26	58.74	220	11,717.20	12,922.80	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	6 个月	新股锁定	10.11	10.11	21,509	217,455.99	217,455.99	-
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	9,217	93,183.87	93,183.87	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-

001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股锁定	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001365	天海电子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	新股锁定	27.19	31.31	572	15,552.68	17,909.32	-
001393	维通利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新股锁定	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定	10.12	27.73	3,471	35,126.52	96,250.83	-
301513	尚水智能	2026 年 4 月 10 日	6 个月	新股锁定	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春光集团	2026 年 4 月 28 日	6 个月	新股锁定	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026 年 4 月 22 日	6 个月	新股锁定	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新股锁定	46.08	463.33	932	42,946.56	431,823.56	-
301669	高特电子	2026 年 6 月 2 日	6 个月	新股锁定	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301680	固德电材	2026 年 2 月 27 日	6 个月	新股锁定	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301682	宏明电子	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股锁定	69.66	160.06	551	38,382.66	88,193.06	-

301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股锁定	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股锁定	11.18	17.59	498	5,567.64	8,759.82	-
603284	林平发展	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股锁定	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股锁定	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股锁定	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
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	104	1,639.04	4,857.84	-
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	新股锁定	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股锁定	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-

688759	必贝特	2025 年 10 月 21 日	9 个月	新股锁定	17.78	30.65	12,552	223,174.56	384,718.80	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁定	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688790	昂瑞微	2025 年 12 月 9 日	9 个月	新股锁定	83.06	126.45	1,594	132,397.64	201,561.30	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688802	沐曦股份	2025 年 12 月 9 日	9 个月	新股锁定	104.66	768.89	1,464	153,222.24	1,125,654.96	-
688808	联讯仪器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新股锁定	81.88	1,584.33	156	12,773.28	247,155.48	-
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股锁定	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股锁定	9.47	70.14	1,650	15,625.50	115,731.00	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁定	19.68	141.49	905	17,810.40	128,048.45	-

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	停牌日期	停牌	期末估值	复牌	复牌开盘单	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	----	------	----	------	----	-------	-------	--------	--------	----

	名 称		原 因	单 价	日 期	价				
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大 事项 停牌	832.00	2026 年 7 月 13 日	890.99	1,279	834,804.98	1,064,128.00	-

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

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

本基金为特殊类型的混合型基金，主要采用追求绝对收益的市场中性策略，与股票市场表现的相关性较低。相对股票型基金和一般的混合型基金，其预期风险较小。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、股指期货等。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控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。

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同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。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、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。

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	1,466,830.99	-	-	-	1,466,830.99
结算备付金	67,108,505.99	-	-	-	67,108,505.99
存出保证金	135,245.83	-	-	56,504,584.80	56,639,830.63
交易性金融资产	46,483,577.26	-	-	538,511,202.54	584,994,779.80
买入返售金融资产	175,007,864.94	-	-	-	175,007,864.94
应收申购款	-	-	-	86,407,601.72	86,407,601.72
资产总计	290,202,025.01	-	-	681,423,389.06	971,625,414.07
负债					
应付赎回款	-	-	-	512,106.97	512,106.97
应付管理人报酬	-	-	-	596,252.33	596,252.33
应付托管费	-	-	-	119,250.48	119,250.48
应付清算款	-	-	-	79,470,342.05	79,470,342.05
应付销售服务费	-	-	-	124,438.18	124,438.18
应交税费	-	-	-	9,475.14	9,475.14
其他负债	-	-	-	497,849.05	497,849.05
负债总计	-	-	-	81,329,714.20	81,329,714.20
利率敏感度缺口	290,202,025.01	-	-	600,093,674.86	890,295,699.87
上年度末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2025 年 12 月 31 日					
资产					
货币资金	2,009,120.95	-	-	-	2,009,120.95
结算备付金	69,573,807.48	-	-	-	69,573,807.48
存出保证金	54,368.08	-	-	38,203,617.60	38,257,985.68
交易性金融资产	32,253,985.58	-	-	351,857,048.68	384,111,034.26
买入返售金融资产	39,500,493.97	-	-	-	39,500,493.97
应收申购款	-	-	-	5,077,579.18	5,077,579.18
应收清算款	-	-	-	621,760.55	621,760.55
资产总计	143,391,776.06	-	-	395,760,006.01	539,151,782.07
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,902,123.54	2,902,123.54
应付管理人报酬	-	-	-	447,535.99	447,535.99
应付托管费	-	-	-	89,507.22	89,507.22
应付销售服务费	-	-	-	80,879.93	80,879.93
应交税费	-	-	-	15.46	15.46
其他负债	-	-	-	460,721.21	460,721.21
负债总计	-	-	-	3,980,783.35	3,980,783.35
利率敏感度缺口	143,391,776.06	-	-	391,779,222.66	535,170,998.72

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，本基金持有交易性债券投资比例较低(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，基金管理人主要运用股指期货等空头工具对持有的股票等权益类多头组合进行对冲操作，规避权益类多头组合的市场系统性风险；同时预留必要的现金，以应对保证金的增加要求或投资者的赎回申请。在股票投资方面，主要采用量化行业配置模型和量化 Alpha 选股模型构建指数增强股票组合，严格控制运作风险，并根据市

场变化趋势，定期对模型进行调整，以改进模型的有效性，最大化超额收益。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合比例为：本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在 80%-120%之间。每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%。在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的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%。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	538,511,202.54	60.49	351,857,048.68	65.75
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	538,511,202.54	60.49	351,857,048.68	65.75

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	55,154.20	1,930,790.80

	沪深 300 指数下降 5%	-55, 154. 20	-1, 930, 790. 80
--	-------------------	--------------	------------------

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	533, 796, 083. 79	345, 717, 988. 75
第二层次	47, 858, 345. 12	36, 003, 331. 80
第三层次	3, 340, 350. 89	2, 389, 713. 71
合计	584, 994, 779. 80	384, 111, 034. 26

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	538,511,202.54	55.42
	其中：股票	538,511,202.54	55.42
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	46,483,577.26	4.78
	其中：债券	46,483,577.26	4.78
	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	175,007,864.94	18.01
	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	68,575,336.98	7.06
8	其他各项资产	143,047,432.35	14.72
9	合计	971,625,414.07	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	-	-
B	采矿业	40,320,056.82	4.53
C	制造业	294,636,902.41	33.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,155,556.11	1.81
E	建筑业	6,940,788.20	0.78
F	批发和零售业	1,322,296.00	0.15
G	交通运输、仓储和邮政业	14,244,045.76	1.60
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	30,605,087.90	3.44
J	金融业	115,192,595.73	12.94
K	房地产业	563,008.00	0.06
L	租赁和商务服务业	3,139,348.00	0.35

M	科学研究和技术服务业	12,959,691.61	1.46
N	水利、环境和公共设施管理业	639,818.00	0.07
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	861,144.00	0.10
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	930,864.00	0.10
S	综合	-	-
	合计	538,511,202.54	60.49

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	600519	贵州茅台	17,504	20,750,816.96	2.33
2	603986	兆易创新	22,207	18,098,705.00	2.03
3	601318	中国平安	371,600	17,740,184.00	1.99
4	300308	中际旭创	12,700	16,129,000.00	1.81
5	688256	寒武纪	9,526	15,199,209.30	1.71
6	601899	紫金矿业	577,800	14,525,892.00	1.63
7	600036	招商银行	359,900	12,776,450.00	1.44
8	603259	药明康德	99,811	12,427,467.61	1.40
9	300750	宁德时代	31,160	12,246,191.60	1.38
10	688012	中微公司	25,884	12,126,654.00	1.36
11	600900	长江电力	422,800	11,191,516.00	1.26
12	688041	海光信息	29,686	10,992,725.80	1.23
13	688981	中芯国际	68,225	10,835,494.50	1.22
14	601398	工商银行	1,520,800	10,752,056.00	1.21
15	600030	中信证券	345,001	9,911,878.73	1.11
16	688008	澜起科技	29,934	9,276,546.60	1.04
17	601166	兴业银行	501,600	8,306,496.00	0.93
18	600183	生益科技	47,900	8,305,860.00	0.93
19	300502	新易盛	12,112	7,351,984.00	0.83
20	600150	中国船舶	189,652	6,408,341.08	0.72
21	600887	伊利股份	266,100	6,375,756.00	0.72
22	600276	恒瑞医药	120,000	6,244,800.00	0.70
23	603993	洛阳钼业	306,200	5,373,810.00	0.60
24	601328	交通银行	814,400	5,236,592.00	0.59
25	603019	中科曙光	47,700	5,114,871.00	0.57
26	601211	国泰海通	275,000	5,005,000.00	0.56
27	601138	工业富联	63,800	4,603,170.00	0.52
28	601288	农业银行	745,700	4,526,399.00	0.51

29	601857	中国石油	505,700	4,389,476.00	0.49
30	000333	美的集团	53,898	4,070,915.94	0.46
31	002415	海康威视	116,298	3,977,391.60	0.45
32	601088	中国神华	98,000	3,825,920.00	0.43
33	300408	三环集团	22,400	3,738,560.00	0.42
34	601688	华泰证券	177,400	3,657,988.00	0.41
35	002475	立讯精密	51,900	3,653,760.00	0.41
36	600031	三一重工	201,900	3,488,832.00	0.39
37	002463	沪电股份	22,700	3,468,560.00	0.39
38	601668	中国建筑	777,980	3,376,433.20	0.38
39	601728	中国电信	608,100	3,156,039.00	0.35
40	000338	潍柴动力	114,800	3,128,300.00	0.35
41	601919	中远海控	235,200	3,118,752.00	0.35
42	000001	平安银行	299,000	3,004,950.00	0.34
43	000792	盐湖股份	98,300	2,967,677.00	0.33
44	600941	中国移动	33,900	2,919,807.00	0.33
45	600089	特变电工	123,900	2,787,750.00	0.31
46	002709	天赐材料	54,200	2,787,506.00	0.31
47	600050	中国联通	693,300	2,773,200.00	0.31
48	601939	建设银行	285,400	2,748,402.00	0.31
49	601600	中国铝业	326,800	2,686,296.00	0.30
50	600309	万华化学	37,000	2,531,170.00	0.28
51	600989	宝丰能源	123,400	2,508,722.00	0.28
52	002371	北方华创	2,810	2,485,613.60	0.28
53	601872	招商轮船	140,300	2,465,071.00	0.28
54	000651	格力电器	65,700	2,463,750.00	0.28
55	601117	中国化学	331,000	2,432,850.00	0.27
56	002142	宁波银行	80,900	2,401,921.00	0.27
57	000425	徐工机械	295,600	2,391,404.00	0.27
58	600111	北方稀土	49,600	2,383,280.00	0.27
59	688111	金山办公	11,042	2,352,498.10	0.26
60	601766	中国中车	451,600	2,348,320.00	0.26
61	601628	中国人寿	66,100	2,336,635.00	0.26
62	000100	TCL 科技	400,000	2,328,000.00	0.26
63	600741	华域汽车	147,595	2,290,674.40	0.26
64	688396	华润微	23,432	2,285,791.60	0.26
65	601077	渝农商行	373,100	2,279,641.00	0.26
66	600999	招商证券	107,200	2,261,920.00	0.25
67	600406	国电南瑞	98,700	2,255,295.00	0.25
68	300033	同花顺	9,000	2,169,000.00	0.24
69	002027	分众传媒	440,000	2,129,600.00	0.24
70	601058	赛轮轮胎	183,500	2,115,755.00	0.24
71	300274	阳光电源	12,840	2,041,816.80	0.23

72	301308	江波龙	2,900	2,041,020.00	0.23
73	601998	中信银行	293,700	2,035,341.00	0.23
74	600028	中国石化	438,300	1,954,818.00	0.22
75	601877	正泰电器	77,900	1,952,953.00	0.22
76	002916	深南电路	4,220	1,932,338.00	0.22
77	600919	江苏银行	174,600	1,882,188.00	0.21
78	000895	双汇发展	84,000	1,881,600.00	0.21
79	600176	中国巨石	24,600	1,792,848.00	0.20
80	603501	豪威集团	17,900	1,697,815.00	0.19
81	000708	中信特钢	133,800	1,688,556.00	0.19
82	600760	中航沈飞	39,500	1,623,450.00	0.18
83	000776	广发证券	67,900	1,588,860.00	0.18
84	601012	隆基绿能	120,200	1,577,024.00	0.18
85	603565	中谷物流	159,300	1,562,733.00	0.18
86	002532	天山铝业	145,400	1,560,142.00	0.18
87	600938	中国海油	57,200	1,552,980.00	0.17
88	600233	圆通速递	97,300	1,532,475.00	0.17
89	600188	兖矿能源	85,800	1,524,666.00	0.17
90	000807	云铝股份	68,300	1,512,162.00	0.17
91	600460	士兰微	27,500	1,503,150.00	0.17
92	601009	南京银行	149,500	1,478,555.00	0.17
93	600489	中金黄金	78,700	1,420,535.00	0.16
94	000938	紫光股份	49,100	1,417,026.00	0.16
95	600085	同仁堂	59,300	1,370,423.00	0.15
96	300628	亿联网络	39,860	1,348,065.20	0.15
97	603558	健盛集团	121,200	1,344,108.00	0.15
98	601225	陕西煤业	65,700	1,336,995.00	0.15
99	300059	东方财富	65,300	1,330,814.00	0.15
100	002049	紫光国微	14,862	1,319,002.50	0.15
101	002384	东山精密	5,000	1,311,750.00	0.15
102	600426	华鲁恒升	52,100	1,246,232.00	0.14
103	002293	罗莱生活	125,100	1,237,239.00	0.14
104	300476	胜宏科技	3,524	1,220,819.32	0.14
105	000975	山金国际	71,300	1,212,100.00	0.14
106	300866	安克创新	11,500	1,201,750.00	0.13
107	603799	华友钴业	24,300	1,172,718.00	0.13
108	601898	中煤能源	95,700	1,165,626.00	0.13
109	000672	上峰材料	48,200	1,141,376.00	0.13
110	688802	沐曦股份	1,464	1,125,654.96	0.13
111	601001	晋控煤业	64,300	1,118,177.00	0.13
112	002043	兔宝宝	100,100	1,109,108.00	0.12
113	601658	邮储银行	220,400	1,086,572.00	0.12
114	688072	拓荆科技	1,279	1,064,128.00	0.12

115	600690	海尔智家	50,900	1,038,869.00	0.12
116	600809	山西汾酒	9,400	1,028,078.00	0.12
117	601888	中国中免	18,800	1,009,748.00	0.11
118	002884	凌霄泵业	62,900	958,596.00	0.11
119	601127	赛力斯	15,600	955,500.00	0.11
120	002558	巨人网络	33,800	931,528.00	0.10
121	601098	中南传媒	94,600	930,864.00	0.10
122	603893	瑞芯微	4,900	922,964.00	0.10
123	600282	南钢股份	200,900	922,131.00	0.10
124	603369	今世缘	38,500	912,835.00	0.10
125	002311	海大集团	20,300	905,583.00	0.10
126	601916	浙商银行	341,700	898,671.00	0.10
127	002839	张家港行	226,700	884,130.00	0.10
128	002233	塔牌集团	126,300	880,311.00	0.10
129	000408	藏格矿业	12,600	873,432.00	0.10
130	600350	山东高速	78,200	870,366.00	0.10
131	605098	行动教育	15,900	861,144.00	0.10
132	003816	中国广核	220,200	860,982.00	0.10
133	601577	长沙银行	98,400	857,064.00	0.10
134	601000	唐山港	206,100	855,315.00	0.10
135	601229	上海银行	98,300	853,244.00	0.10
136	601788	光大证券	58,800	848,484.00	0.10
137	601963	重庆银行	83,700	843,696.00	0.09
138	688472	阿特斯	77,100	834,222.00	0.09
139	600346	恒力石化	46,600	825,286.00	0.09
140	600096	云天化	26,900	817,760.00	0.09
141	002594	比亚迪	10,200	812,940.00	0.09
142	600066	宇通客车	29,800	798,938.00	0.09
143	600901	江苏金租	136,400	784,300.00	0.09
144	000725	京东方 A	89,600	777,728.00	0.09
145	002966	苏州银行	111,400	775,344.00	0.09
146	002493	荣盛石化	71,400	767,550.00	0.09
147	603967	中创物流	74,100	766,935.00	0.09
148	601339	百隆东方	113,200	766,364.00	0.09
149	301165	锐捷网络	9,400	756,230.00	0.08
150	600886	国投电力	56,800	756,008.00	0.08
151	600885	宏发股份	21,700	748,433.00	0.08
152	603195	公牛集团	19,100	747,765.00	0.08
153	601818	XD 光大银	256,900	742,441.00	0.08
154	600926	杭州银行	50,700	732,615.00	0.08
155	000301	东方盛虹	62,900	720,205.00	0.08
156	600295	鄂尔多斯	67,100	719,312.00	0.08
157	601816	京沪高铁	158,200	716,646.00	0.08

158	000166	申万宏源	153,800	676,720.00	0.08
159	300124	汇川技术	10,200	676,566.00	0.08
160	600674	川投能源	47,425	672,012.25	0.08
161	002602	世纪华通	46,500	655,650.00	0.07
162	600323	瀚蓝环境	23,300	639,818.00	0.07
163	605117	德业股份	6,000	637,080.00	0.07
164	600398	海澜之家	121,600	635,968.00	0.07
165	603337	杰克科技	17,400	630,402.00	0.07
166	601187	厦门银行	91,800	626,994.00	0.07
167	600018	上港集团	132,300	624,456.00	0.07
168	000963	华东医药	21,200	596,144.00	0.07
169	601298	青岛港	73,900	594,895.00	0.07
170	600012	皖通高速	37,700	594,152.00	0.07
171	601390	中国中铁	141,500	590,055.00	0.07
172	002533	金杯电工	54,500	581,515.00	0.07
173	600803	新奥股份	36,600	578,280.00	0.06
174	002416	爱施德	64,200	575,232.00	0.06
175	300394	天孚通信	1,900	575,092.00	0.06
176	600048	保利发展	121,600	563,008.00	0.06
177	603659	璞泰来	19,400	561,242.00	0.06
178	601985	中国核电	61,300	553,539.00	0.06
179	002414	高德红外	41,100	544,986.00	0.06
180	601186	中国铁建	91,000	541,450.00	0.06
181	600115	中国东航	141,900	540,639.00	0.06
182	300012	华测检测	38,400	532,224.00	0.06
183	600795	国电电力	112,400	524,908.00	0.06
184	600000	浦发银行	58,000	499,380.00	0.06
185	000988	华工科技	2,700	498,447.00	0.06
186	603365	水星家纺	31,500	490,455.00	0.06
187	002236	大华股份	29,600	488,104.00	0.05
188	600522	中天科技	8,000	485,440.00	0.05
189	603699	纽威股份	9,600	482,880.00	0.05
190	002895	川恒股份	16,500	481,800.00	0.05
191	300450	先导智能	11,700	476,424.00	0.05
192	600546	山煤国际	40,800	445,944.00	0.05
193	601238	广汽集团	86,600	439,928.00	0.05
194	002128	电投能源	18,900	436,968.00	0.05
195	301666	大普微	932	431,823.56	0.05
196	000999	华润三九	18,970	426,635.30	0.05
197	600600	青岛啤酒	8,000	417,840.00	0.05
198	601319	中国人保	61,200	413,712.00	0.05
199	600875	东方电气	14,300	411,411.00	0.05
200	002028	思源电气	2,300	397,900.00	0.04

201	600025	华能水电	43,600	387,604.00	0.04
202	688759	必贝特	12,552	384,718.80	0.04
203	002202	金风科技	16,000	382,400.00	0.04
204	002126	银轮股份	7,300	363,540.00	0.04
205	688521	芯原股份	975	361,861.50	0.04
206	603298	杭叉集团	15,100	360,286.00	0.04
207	002001	新 和 成	12,200	346,724.00	0.04
208	600893	航发动力	9,000	345,060.00	0.04
209	603296	华勤技术	4,500	334,215.00	0.04
210	002050	三花智控	7,500	328,725.00	0.04
211	600930	华电新能	67,100	320,067.00	0.04
212	000830	鲁西化工	26,000	312,000.00	0.04
213	001248	华润新能源	30,726	310,639.86	0.03
214	002541	鸿路钢构	17,200	297,904.00	0.03
215	600285	羚锐制药	13,200	255,816.00	0.03
216	688808	联讯仪器	156	247,155.48	0.03
217	600016	民生银行	73,900	237,958.00	0.03
218	688790	昂瑞微	1,594	201,561.30	0.02
219	601607	上海医药	9,800	150,920.00	0.02
220	688820	盛合晶微	905	128,048.45	0.01
221	300014	亿纬锂能	1,800	117,054.00	0.01
222	688818	电科蓝天	1,650	115,731.00	0.01
223	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.01
224	001399	惠科股份	3,471	96,250.83	0.01
225	301682	宏明电子	551	88,193.06	0.01
226	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.01
227	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.01
228	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
229	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
230	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
231	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
232	001365	天海电子	572	17,909.32	0.00
233	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
234	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
235	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
236	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
237	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
238	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
239	001237	惠康科技	220	12,922.80	0.00
240	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
241	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
242	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
243	601112	振石股份	498	8,759.82	0.00

244	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
245	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
246	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
247	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
248	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
249	002179	中航光电	40	1,848.00	0.00
250	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
251	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
252	000429	粤高速 A	2	27.30	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	600519	贵州茅台	26,849,800.70	5.02
2	601318	中国平安	23,103,207.56	4.32
3	601899	紫金矿业	18,405,760.00	3.44
4	600036	招商银行	17,074,619.00	3.19
5	688256	寒武纪	14,977,572.86	2.80
6	603259	药明康德	14,489,732.17	2.71
7	600900	长江电力	14,414,204.00	2.69
8	603986	兆易创新	13,711,496.31	2.56
9	300308	中际旭创	12,651,919.60	2.36
10	601166	兴业银行	12,490,198.00	2.33
11	601398	工商银行	11,834,748.00	2.21
12	688041	海光信息	11,601,890.20	2.17
13	688008	澜起科技	11,142,087.16	2.08
14	688981	中芯国际	10,788,694.05	2.02
15	600030	中信证券	10,735,098.00	2.01
16	688012	中微公司	10,565,586.34	1.97
17	600150	中国船舶	10,240,277.80	1.91
18	600887	伊利股份	9,166,747.00	1.71
19	300750	宁德时代	8,693,571.00	1.62
20	603993	洛阳钼业	8,368,591.00	1.56

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	600519	贵州茅台	15,520,967.00	2.90
2	601318	中国平安	13,080,385.00	2.44
3	300750	宁德时代	10,956,147.00	2.05
4	600036	招商银行	10,747,957.00	2.01
5	601899	紫金矿业	10,380,674.00	1.94

6	601166	兴业银行	9,136,661.00	1.71
7	300308	中际旭创	8,366,693.00	1.56
8	603259	药明康德	8,350,428.01	1.56
9	300502	新易盛	6,845,279.00	1.28
10	601225	陕西煤业	6,816,480.00	1.27
11	600150	中国船舶	6,802,595.60	1.27
12	300274	阳光电源	6,386,301.00	1.19
13	600900	长江电力	6,348,812.00	1.19
14	600919	江苏银行	6,233,274.00	1.16
15	601919	中远海控	6,231,523.00	1.16
16	600989	宝丰能源	6,145,615.00	1.15
17	600887	伊利股份	6,043,781.00	1.13
18	002028	思源电气	5,879,473.65	1.10
19	601728	中国电信	5,854,772.00	1.09
20	000333	美的集团	5,701,463.00	1.07

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	1,006,692,624.23
卖出股票收入（成交）总额	838,788,796.15

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

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	46,483,577.26	5.22
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	46,483,577.26	5.22

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019792	25 国债 19	220,000	22,230,831.23	2.50
2	019785	25 国债 13	70,000	7,088,378.36	0.80

3	102317	国债 2519	40,000	4,041,969.32	0.45
4	019771	25 国债 06	40,000	4,032,018.63	0.45
5	102310	国债 2513	30,000	3,037,876.44	0.34

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

本基金主要运用股指期货合约进行套期保值操作，规避市场系统性风险。在完全套保的理念下，本基金根据股票多头组合的市值计算股指期货合约卖单量，并根据市场变化对股指期货合约卖单量进行动态跟踪并适时调整。同时，综合考虑定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在不同股指期货合约之间进行动态配置，并适时进行合约展期操作，以求提高组合收益和套期保值的效果。

本基金投资于股指期货，为特殊类型的混合型基金，主要采用追求绝对收益的市场中性策略，与股票市场表现的相关性较低。相对股票型基金和一般的混合型基金，其预期风险较小。本基金的投资符合既定的投资政策和投资目标。

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 市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本基金持有股票资产 538,511,202.54 元，占基金资产净值的比例为 60.49%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值-470,871,540.00 元，占基金资产净值的比例为-52.89%，空头合约市值占股票资产的比例为-87.44%。本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 26,043,774.34 元，公允价值变动损益为-21,431,980.39 元。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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

华宝量化对冲混合截止 2026 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 招商银行股份有限公司因内部制度不完善; 于 2025 年 09 月 12 日收到金融监管总局警告, 罚款的处罚措施。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和分析, 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。

7.13.2 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。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位: 人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	56,639,830.63
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	86,407,601.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	143,047,432.35

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因, 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	户均持有的基	持有人结构
------	-----	--------	-------

	户数 (户)	金份额	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 对冲混合 A	13,697	10,933.64	68,983,455.07	46.06	80,774,544.39	53.94
华宝量化 对冲混合 C	57,148	2,322.82	24,711,445.15	18.62	108,033,351.26	81.38
华宝量化 对冲混合 D	111	4,239,721.16	470,087,810.12	99.89	521,238.42	0.11
合计	70,956	10,613.79	563,782,710.34	74.86	189,329,134.07	25.14

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（%）	90.22

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	华宝量化对冲混合 A	118,952.20	0.0794
	华宝量化对冲混合 C	418.33	0.0003
	华宝量化对冲混合 D	58,979.36	0.0125
	合计	178,349.89	0.0237

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、 基金投资和相关部门 负责人持有本开放式 基金	华宝量化对冲混合 A	10~50
	华宝量化对冲混合 C	0~10
	华宝量化对冲混合 D	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有 本开放式基金	华宝量化对冲混合 A	0
	华宝量化对冲混合 C	0
	华宝量化对冲混合 D	0~10
	合计	0~10

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	华宝量化对冲混合 A	华宝量化对冲混合 C	华宝量化对冲混合 D
基金合同生效日（2014 年 9 月 17 日）基金份额总额	539,601,058.43	67,437,011.52	—
本报告期期初基金份额总额	175,112,564.80	138,531,251.77	146,393,799.56
本报告期基金总申购份额	167,279,927.33	125,442,515.63	493,335,124.57
减：本报告期基金总赎回份额	192,634,492.67	131,228,970.99	169,119,875.59
本报告期基金拆分变动份额	—	—	—
本报告期期末基金份额总额	149,757,999.46	132,744,796.41	470,609,048.54

§ 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：2024 年 10 月 23 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

本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及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 (%)	
东方财富	2	385,314,165.95	20.91	167,960.84	20.91	—
中信证券	5	192,818,829.49	10.46	84,049.47	10.46	—
东吴证券	2	169,799,115.92	9.21	74,014.57	9.21	—
华泰证券	3	159,707,158.65	8.66	69,617.89	8.66	—
财通证券	3	150,688,588.87	8.18	65,688.69	8.18	—
国联民生	5	148,421,441.17	8.05	64,701.48	8.05	—
浙商证券	3	127,920,232.72	6.94	55,760.58	6.94	—
华源证券	2	125,139,302.99	6.79	54,548.31	6.79	—
华创证券	2	98,337,471.34	5.34	42,868.34	5.34	—
天风证券	4	37,601,345.94	2.04	16,390.19	2.04	—
麦高证券	2	36,731,030.42	1.99	16,010.47	1.99	—
长江证券	1	35,757,238.46	1.94	15,586.65	1.94	—
广发证券	4	35,184,758.48	1.91	15,337.48	1.91	—
国泰海通	3	34,378,078.4	1.87	14,986.84	1.87	—

		9				
中信建投	2	29,336,404.05	1.59	12,788.32	1.59	-
申万宏源	3	28,189,624.81	1.53	12,287.65	1.53	-
国海证券	2	27,951,582.34	1.52	12,185.58	1.52	-
中泰证券	1	11,796,308.79	0.64	5,142.17	0.64	-
国投证券	2	8,073,047.00	0.44	3,519.40	0.44	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
诚通证券	1	-	-	-	-	-
大和证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
华兴证券	2	-	-	-	-	-
金融街证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-

招商证券	4	-	-	-	-	-
中金国际	2	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
中邮证券	1	-	-	-	-	-
甬兴证券	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: 资质雄厚，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、本报告期租用的证券公司交易单元新增的有：国盛证券、麦高证券、天风证券；退租交易单元：广发证券、国联民生证券。

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

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 (%)
东方财富	2,321,787.05	4.56	1,699,000,000.00	14.16	-	-
中信证券	3,000,345.21	5.90	295,000,000.00	2.46	-	-
东吴证券	-	-	1,619,700,000.00	13.50	-	-
华泰证券	3,530,731.44	6.94	526,900,000.00	4.39	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
国联民生	-	-	183,500,000.00	1.53	-	-

浙商证券	-	-	30,000,000.00	0.25	-	-
华源证券	8,283,171.65	16.28	2,158,000,000.00	17.99	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	3,021,110.13	5.94	527,000,000.00	4.39	-	-
麦高证券	-	-	618,200,000.00	5.15	-	-
长江证券	3,014,958.90	5.93	303,615,000.00	2.53	-	-
广发证券	-	-	1,073,412,000.00	8.95	-	-
国泰海通	4,038,414.80	7.94	-	-	-	-
中信建投	-	-	56,000,000.00	0.47	-	-
申万宏源	4,029,847.67	7.92	1,254,800,000.00	10.46	-	-
国海证券	19,633,716.77	38.59	800,000,000.00	6.67	-	-
中泰证券	-	-	850,500,000.00	7.09	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
大和证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-

华金证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
华兴证券	-	-	-	-	-	-
金融街证 券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金国际	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-
甬兴证券	-	-	-	-	-	-

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	2026-01-16
2	华宝量化对冲策略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
3	华宝量化对冲策略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
4	华宝基金关于旗下部分基金新增中国邮政储蓄银行股份有限公司(“邮你同赢”平台)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	2026-04-01
5	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
6	华宝量化对冲策略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
7	华宝基金关于旗下部分基金新增中国	基金管理人网站, 上海	2026-06-04

	邮政储蓄银行股份有限公司为代销机构的公告	证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	
8	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
9	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

§ 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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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；
华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金基金合同；
华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金招募说明书；
华宝量化对冲策略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住所备投资者查阅。

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