# 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(原华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金转型)
# 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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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 09 日（基金合同生效日）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 ..... 6**

2.1 基金基本情况（转型后） ..... 6
2.1 基金基本情况（转型前） ..... 6
2.2 基金产品说明（转型后） ..... 7
2.2 基金产品说明（转型前） ..... 7
2.3 基金管理人和基金托管人 ..... 7
2.4 信息披露方式 ..... 8
2.5 其他相关资料(转型后) ..... 8
2.5 其他相关资料(转型前) ..... 8

**§3 主要财务指标和基金净值表现 ..... 8**

3.1 主要会计数据和财务指标（转型后） ..... 8
3.1 主要会计数据和财务指标(转型前) ..... 9
3.2 基金净值表现（转型后） ..... 10
3.2 基金净值表现（转型前） ..... 12

**§4 管理人报告 ..... 14**

4.1 基金管理人及基金经理情况 ..... 14
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 ..... 18
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 ..... 18
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 ..... 19
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 ..... 20
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 ..... 20
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 ..... 21
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 ..... 21

**§5 托管人报告 ..... 21**

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 ..... 21
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 ..... 21
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 ..... 21

**§6 半年度财务会计报告（未经审计)（转型后） ..... 22**

6.1 资产负债表 ..... 22
6.2 利润表 ..... 23
6.3 净资产变动表 ..... 24
6.4 报表附注 ..... 26

**§6 半年度财务会计报告（未经审计)（转型前） ..... 52**

6.1 资产负债表 ..... 52
6.2 利润表 ..... 53
6.3 净资产变动表 ..... 54
6.4 报表附注 ..... 57

**§7 投资组合报告（转型后） ..... 80**

7.1 期末基金资产组合情况 ..... 80
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 ..... 81
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 ..... 82
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 ..... 82
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 ..... 85
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 ..... 85
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 ..... 85
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 ..... 85
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 ..... 85
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 ..... 85
7.11 本基金投资股指期货的投资政策 ..... 86
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 ..... 86
7.13 投资组合报告附注 ..... 86

**§7 投资组合报告（转型前） ..... 87**

7.1 期末基金资产组合情况 ..... 87
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 ..... 88
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 ..... 89
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 ..... 95
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 ..... 96
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 ..... 96
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 ..... 97
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 ..... 97
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 ..... 97
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 ..... 97
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 ..... 97
7.12 投资组合报告附注 ..... 97

**§8 基金份额持有人信息（转型后） ..... 98**

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 ..... 98
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 ..... 99
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 ..... 99
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 ..... 99

**§8 基金份额持有人信息（转型前） ..... 99**

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 ..... 99
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 ..... 99
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 ..... 100
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 ..... 100

**§9 开放式基金份额变动（转型后） ..... 100**

**§9 开放式基金份额变动（转型前） ..... 101**

**§10 重大事件揭示 ..... 101**

10.1 基金份额持有人大会决议 ..... 101
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 ..... 101
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 ..... 101
10.4 基金投资策略的改变 ..... 101
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 ..... 101
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 ..... 102
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(转型后) ..... 102
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(转型前) ..... 103
10.8 其他重大事件（转型后） ..... 104
10.8 其他重大事件（转型前） ..... 105

**§11 影响投资者决策的其他重要信息 ..... 106**

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 ..... 106
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 ..... 106

**§12 备查文件目录 ..... 106**

12.1 备查文件目录 ..... 106
12.2 存放地点 ..... 106
12.3 查阅方式 ..... 107

# §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况（转型后）

| | | |
|---|---|---|
| 基金名称 | 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 | |
| 基金简称 | 华宝沪深 300 增强策略 ETF 发起式联接 | |
| 基金主代码 | 003876 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2026 年 1 月 9 日 | |
| 基金管理人 | 华宝基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 286,072,836.78 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 华宝沪深 300 增强策略 ETF 发起式联接 A | 华宝沪深 300 增强策略 ETF 发起式联接 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 003876 | 007404 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 269,092,285.65 份 | 16,980,551.13 份 |

## 2.1.1 目标基金基本情况（转型后）

| | |
|---|---|
| 基金名称 | 华宝沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金主代码 | 562070 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2025 年 12 月 17 日 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所 |
| 上市日期 | 2025 年 12 月 25 日 |
| 基金管理人名称 | 华宝基金管理有限公司 |
| 基金托管人名称 | 中国农业银行股份有限公司 |

## 2.1 基金基本情况（转型前）

| | | |
|---|---|---|
| 基金名称 | 华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 | |
| 基金简称 | 华宝沪深 300 增强 | |
| 基金主代码 | 003876 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2016 年 12 月 9 日 | |
| 基金管理人 | 华宝基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 1,122,845,309.04 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基 | 华宝沪深 300 增强 A | 华宝沪深 300 增强 C |

| | | |
|---|---|---|
| 金简称 | | |
| 下属分级基金的交易代码 | 003876 | 007404 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 974,300,564.88 份 | 148,544,744.16 份 |

## 2.2 基金产品说明（转型后）

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金主要通过投资于目标 ETF，在力求有效跟踪标的指数基础上，力争获取超越指数表现的投资收益。 |
| 投资策略 | 本基金主要投资于目标 ETF。本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%。同时，基于流动性管理及策略性投资的需要，本基金也会在控制风险前提下适度投资于债券、股指期货、货币市场工具及其他金融工具。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×95%＋人民币银行活期存款利率（税后）×5% |
| 风险收益特征 | 本基金为 ETF 联接基金，目标 ETF 为股票型指数基金，本基金的预期风险与收益理论上高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 |

### 2.2.1 目标基金产品说明（转型后）

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过量化的方法进行积极的组合管理与严格的风险控制，力争实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。 |
| 投资策略 | 本基金为增强型指数基金，主要投资于沪深 300 指数成份股及备选股票。本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于沪深 300 指数成份股及备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。大类资产配置不作为本基金的核心策略。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出合适调整。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。同时，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。 |

## 2.2 基金产品说明（转型前）

## 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 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 周雷 | 任航 |
| | 联系电话 | 021-38505888 | 010-66060069 |
| | 电子邮箱 | xxpl@fsfund.com | tgxxpl@abchina.com |
| 客户服务电话 | | 400-700-5588、400-820-5050 | 95599 |
| 传真 | | 021-38505777 | 010-68121816 |
| 注册地址 | | 中国（上海）自由贸易试验区世 | 北京市东城区建国门内大街 69 |

| | | |
|---|---|---|
| | 纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼 | 号 |
| 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 28 号凯晨世贸中心东座 F9 |
| 邮政编码 | 200120 | 100031 |
| 法定代表人 | 夏雪松 | 谷澍 |

## 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办公场所。 |

## 2.5 其他相关资料(转型后)

| 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 |

## 2.5 其他相关资料(转型前)

| 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（转型后）

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2026 年 1 月 9 日（基金合同生效日） - 2026 年 6 月 30 日 | |
|---|---|---|
| | 华宝沪深 300 增强策略 ETF 发起式联接 A | 华宝沪深 300 增强策略 ETF 发起式联接 C |
| 本期已实现收益 | 112,741,514.01 | 15,067,294.12 |
| 本期利润 | 28,354,677.12 | 2,083,085.00 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0623 | 0.0535 |
| 本期加权平均净值利润率 | 4.33% | 3.86% |
| 本期基金份额净值增长率 | 6.43% | 6.21% |

| 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 | 71,947,558.62 | 3,595,476.58 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.2674 | 0.2117 |
| 期末基金资产净值 | 411,280,664.21 | 24,974,684.98 |
| 期末基金份额净值 | 1.5284 | 1.4708 |
| 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 | 6.43% | 6.21% |

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。

5.本基金合同在当期生效。

## 3.1 主要会计数据和财务指标(转型前)

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 1 月 8 日) | |
|---|---|---|
| | 华宝沪深 300 增强 A | 华宝沪深 300 增强 C |
| 本期已实现收益 | -309,775.37 | -39,599.00 |
| 本期利润 | 27,063,822.34 | 4,002,189.09 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0277 | 0.0329 |
| 本期加权平均净值利润率 | 1.93% | 2.37% |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.97% | 1.97% |

| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2026 年 1 月 8 日) | |
|---|---|---|
| 期末可供分配利润 | 125,700,784.18 | 12,053,799.50 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.1290 | 0.0811 |
| 期末基金资产净值 | 1,399,219,741.66 | 205,698,041.73 |
| 期末基金份额净值 | 1.4361 | 1.3848 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2026 年 1 月 8 日) | |
| 基金份额累计净值增长率 | 108.68% | 72.90% |

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（转型后）

### 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

华宝沪深 300 增强策略 ETF 发起式联接 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 | 11.90% | 1.16% | 11.30% | 1.19% | 0.60% | -0.03% |
| 过去六个月 | - | - | - | - | - | - |
| 过去一年 | - | - | - | - | - | - |
| 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 | 6.43% | 1.02% | 4.89% | 1.07% | 1.54% | -0.05% |

华宝沪深 300 增强策略 ETF 发起式联接 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 | 11.79% | 1.16% | 11.30% | 1.19% | 0.49% | -0.03% |
| 过去六个月 | - | - | - | - | - | - |
| 过去一年 | - | - | - | - | - | - |
| 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 | 6.21% | 1.02% | 4.89% | 1.07% | 1.32% | -0.05% |

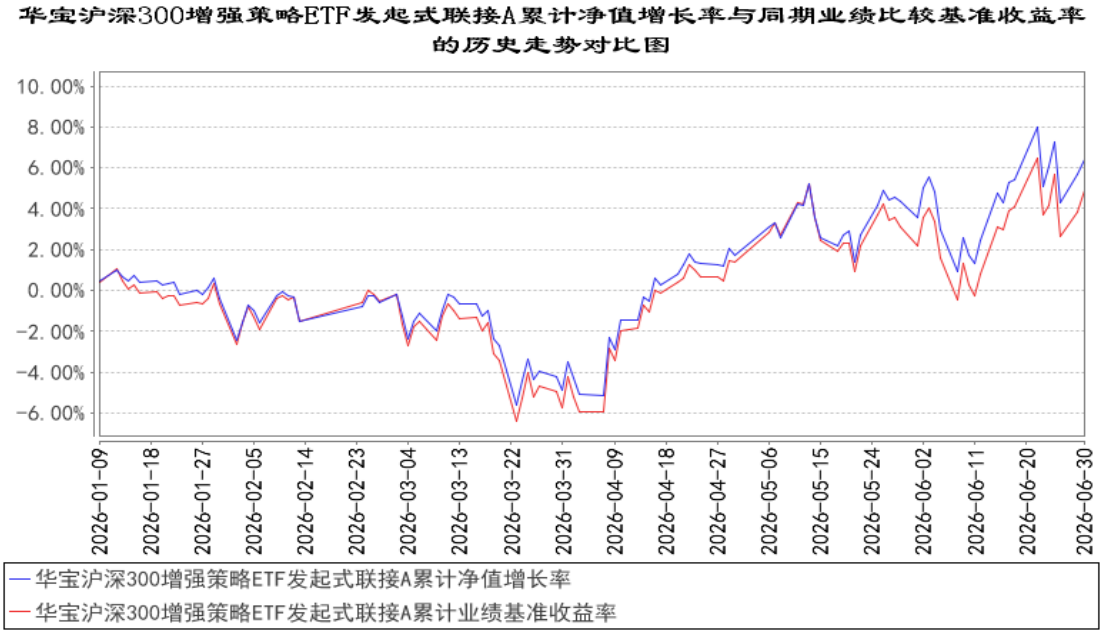
注：

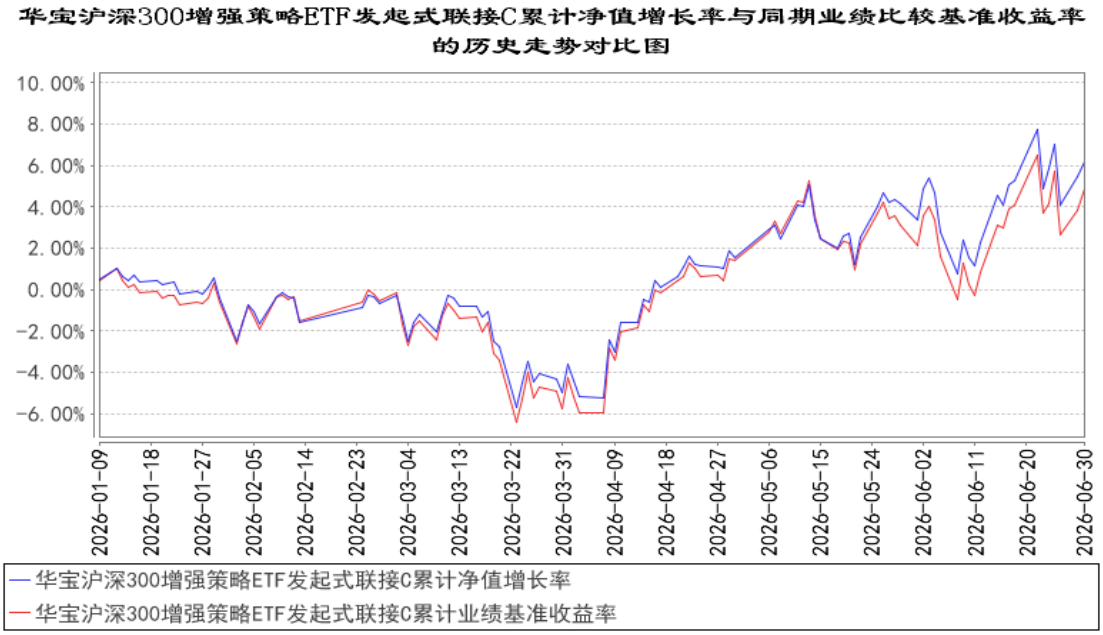
（1）本基金自 2026 年 1 月 9 日起，由华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金转型而来，截止报告日本基金基金合同自转型之日起生效未满一年；

（2）基金业绩基准：沪深 300 指数收益率×95%＋人民币银行活期存款利率（税后）×5%；

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




注：1、本基金基金合同生效于 2026 年 01 月 09 日,截止报告日本基金基金合同生效未满一年。

2、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六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期。

## 3.2 基金净值表现（转型前）

### 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

华宝沪深 300 增强 A

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差 | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标 | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|

| | | ② | | 准差④ | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 3.11% | 0.87% | 2.41% | 0.93% | 0.70% | -0.06% |
| 过去六个月 | 18.96% | 0.84% | 18.40% | 0.89% | 0.56% | -0.05% |
| 过去一年 | 26.96% | 0.87% | 25.56% | 0.91% | 1.40% | -0.04% |
| 过去三年 | 27.09% | 0.99% | 23.62% | 1.02% | 3.47% | -0.03% |
| 过去五年 | -7.04% | 1.06% | -6.09% | 1.08% | -0.95% | -0.02% |
| 过去七年 | 105.84% | 1.14% | 69.75% | 1.14% | 36.09% | 0.00% |
| 过去十年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | 108.68% | 1.12% | 54.99% | 1.11% | 53.69% | 0.01% |

华宝沪深 300 增强 C

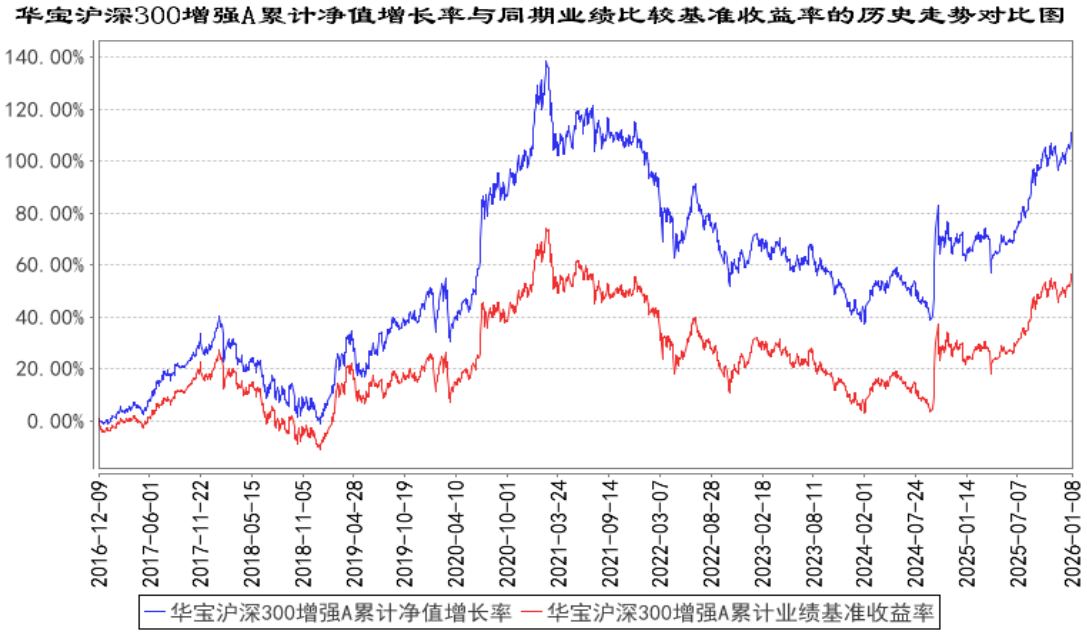
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 3.02% | 0.87% | 2.41% | 0.93% | 0.61% | -0.06% |
| 过去六个月 | 18.76% | 0.84% | 18.40% | 0.89% | 0.36% | -0.05% |
| 过去一年 | 26.48% | 0.87% | 25.56% | 0.91% | 0.92% | -0.04% |
| 过去三年 | 25.59% | 0.99% | 23.62% | 1.02% | 1.97% | -0.03% |
| 过去五年 | -8.86% | 1.06% | -6.09% | 1.08% | -2.77% | -0.02% |
| 过去七年 | - | - | - | - | - | - |
| 过去十年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | 72.90% | 1.11% | 44.25% | 1.11% | 28.65% | 0.00% |

注：（1）本基金成立于 2016 年 12 月 09 日；

（2）基金业绩基准：沪深 300 指数收益率*95%+1.5%（指年收益率，评价时按期间折算）；

（3）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



注：本基金于 2026 年 1 月 9 日转型。

## §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（转型后）**

| 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、量化投资部总经理 | 2026-01-09 | - | 24 年 | 硕士。曾在兴业证券、凯龙财经（上海）有限公司、中原证券从事金融工程研究工作。2005 年 8 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任金融工程部数量分析师、金融工程部副总经理等职务，现任量化投资总监、量化投资部总经理。2009 年 9 月至 2015 年 11 月任华宝中证 100 指数证券投资基金基金经理，2010 年 4 月至 2015 年 11 月任上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2014 年 9 月起任华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金基金经理，2015 年 4 月至 2020 年 2 月任华宝事件驱动混合型证券投资基金基金经理，2016 年 12 月至 2026 年 1 月任华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理，2019 年 2 月至 2022 年 10 月任华宝科技先锋混合型证券投资基金基金经理，2021 年 12 月至 2023 年 11 月任华宝中证稀有金属主题指数增强型发起式证券投资基金基金经理，2022 年 8 月至 2023 年 11 月任华宝高端装备股票型发起式证券投资基金基金经理，2023 年 2 月起任华宝量化选股混合型发起式证券投资基金基金经理，2025 年 6 月起任华宝中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理，2025 年 12 月起任华宝沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2026 年 1 月起任华宝沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 王正 | 本基金基金经理 | 2026-01-09 | - | 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。

## 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

| 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、量化投资部总经理 | 2016-12-09 | 2026-01-08 | 24 年 | 硕士。曾在兴业证券、凯龙财经（上海）有限公司、中原证券从事金融工程研究工作。2005 年 8 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任金融工程部数量分析师、金融工程部副总经理等职务，现任量化投资总监、量化投资部总经理。2009 年 9 月至 2015 年 11 月任华宝中证 100 指 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | 数证券投资基金基金经理，2010 年 4 月至 2015 年 11 月任上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2014 年 9 月起任华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金基金经理，2015 年 4 月至 2020 年 2 月任华宝事件驱动混合型证券投资基金基金经理，2016 年 12 月至 2026 年 1 月任华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理，2019 年 2 月至 2022 年 10 月任华宝科技先锋混合型证券投资基金基金经理，2021 年 12 月至 2023 年 11 月任华宝中证稀有金属主题指数增强型发起式证券投资基金基金经理，2022 年 8 月至 2023 年 11 月任华宝高端装备股票型发起式证券投资基金基金经理，2023 年 2 月起任华宝量化选股混合型发起式证券投资基金基金经理，2025 年 6 月起任华宝中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理，2025 年 12 月起任华宝沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2026 年 1 月起任华宝沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。 |
| 王正 | 本基金基金经理 | 2020-01-02 | 2026-01-08 | 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（转型后）

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。

### 4.1.3 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（转型前）

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。报告期内本基金跟踪的沪深 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 环境不太友好。

本基金作为联接基金，基金资产 90%以上持有对应的增强 ETF 份额，底层仍为沪深 300 增强策略，在沪深 300 成分股及备选股内精选业绩和估值相匹配、基本面优质的股票，并严格控制市值、行业等风险暴露，在有限的跟踪误差下力争实现稳定的超越指数的表现，另有小部分仓位视基差情况投资于沪深 300 股指期货。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金自转型以来，本报告期基金份额 A 类净值增长率为 6.43%，本报告期基金份额 C 类净

值增长率为 6.21%;同期业绩比较基准收益率为 4.89%。

## 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，同时在组合优化上注重行业和个股的分散、风格的均衡以及风险的控制。

## 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

本基金本报告期未进行利润分配，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

本基金为发起式基金，且截至本报告期末，本基金基金合同生效未满 3 年，暂不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

## §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，中国农业银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）在本基金的托管过程中，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、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对本基金的投资运作情况进行了必要的监督，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支、利润分配等方面进行了复核，未发现基金管理人有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的真实、准确和完整发表意见

本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，以自身能够获取的数据和信息为限，对本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行核查，以上内容真实、准确、完整。

# §6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）

## 6.1 资产负债表

会计主体：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

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<br>2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|
| **资 产：** | | |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 4,862,811.08 |
| 结算备付金 | | 3,171,450.09 |
| 存出保证金 | | 1,458,046.67 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 428,366,273.59 |
| 其中：股票投资 | | 7,598,408.75 |
| 基金投资 | | 398,819,741.30 |
| 债券投资 | | 21,948,123.54 |
| 资产支持证券投资 | | - |
| 贵金属投资 | | - |
| 其他投资 | | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - |
| 债权投资 | | - |
| 其中：债券投资 | | - |
| 资产支持证券投资 | | - |
| 其他投资 | | - |
| 其他债权投资 | | - |
| 其他权益工具投资 | | - |
| 应收清算款 | | 175,359.24 |
| 应收股利 | | - |
| 应收申购款 | | 267,489.97 |
| 递延所得税资产 | | - |
| 其他资产 | 6.4.7.5 | - |
| 资产总计 | | 438,301,430.64 |
| **负债和净资产** | **附注号** | **本期末<br>2026 年 6 月 30 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 | | 1,766,900.86 |

| | | |
|---|---|---|
| 应付管理人报酬 | | 24,574.82 |
| 应付托管费 | | 3,071.88 |
| 应付销售服务费 | | 8,083.72 |
| 应付投资顾问费 | | - |
| 应交税费 | | 29,782.53 |
| 应付利润 | | - |
| 递延所得税负债 | | - |
| 其他负债 | 6.4.7.6 | 213,667.64 |
| 负债合计 | | 2,046,081.45 |
| **净资产：** | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 286,072,836.78 |
| 其他综合收益 | | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | 150,182,512.41 |
| 净资产合计 | | 436,255,349.19 |
| 负债和净资产总计 | | 438,301,430.64 |

注：1.本基金合同生效日为 2026 年 01 月 09 日，本报告期自基金合同生效日 2026 年 01 月 09 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

2.报告截止日 2026 年 06 月 30 日,基金份额总额 286,072,836.78 份，其中华宝沪深 300 增强策略 ETF 发起式联接 A 基金份额总额 269,092,285.65 份，基金份额净值 1.5284 元；华宝沪深 300 增强策略 ETF 发起式联接 C 基金份额总额 16,980,551.13 份，基金份额净值 1.4708 元。

## 6.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2026 年 1 月 9 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期<br>2026 年 1 月 9 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|
| **一、营业总收入** | | 31,491,427.66 |
| 1.利息收入 | | 183,659.83 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 53,026.01 |
| 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 | | 130,633.82 |
| 其他利息收入 | | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 128,671,591.54 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | 116,402,475.93 |
| 基金投资收益 | 6.4.7.11 | 1,690,091.35 |
| 债券投资收益 | 6.4.7.12 | 285,421.00 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.13 | - |

| | | |
|---|---|---|
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.14 | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.15 | 9,400,290.82 |
| 股利收益 | 6.4.7.16 | 893,312.44 |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益 | | - |
| 其他投资收益 | | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | -97,371,046.01 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18 | 7,222.30 |
| **减：二、营业总支出** | | 1,053,665.54 |
| 1．管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 743,336.15 |
| 其中：暂估管理人报酬 | | - |
| 2．托管费 | 6.4.10.2.2 | 92,917.01 |
| 3．销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 100,232.30 |
| 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 | 6.4.7.19 | - |
| 7．税金及附加 | | 37,009.44 |
| 8．其他费用 | 6.4.7.20 | 80,170.64 |
| **三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）** | | 30,437,762.12 |
| 减：所得税费用 | | - |
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** | | 30,437,762.12 |
| **五、其他综合收益的税后净额** | | - |
| **六、综合收益总额** | | 30,437,762.12 |

注：1.本基金合同生效日为 2026 年 01 月 09 日，故无上年度可比期间。

## 6.3 净资产变动表

会计主体：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

本报告期：2026 年 1 月 9 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 9 日（基金合同生效日）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 | - | - | - | - |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 1,122,845,309.04 | - | 482,072,474.35 | 1,604,917,783.39 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | -836,772,472.26 | - | -331,889,961.94 | -1,168,662,434.20 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 30,437,762.12 | 30,437,762.12 |
| (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) | -836,772,472.26 | - | -362,327,724.06 | -1,199,100,196.32 |
| 其中：1.基金申购款 | 33,265,096.18 | - | 13,674,478.08 | 46,939,574.26 |
| 2.基金赎回款 | -870,037,568.44 | - | -376,002,202.14 | -1,246,039,770.58 |
| (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 | 286,072,836.78 | - | 150,182,512.41 | 436,255,349.19 |

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 | 李孟恒 | 张幸骏 |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华宝沪深 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(以下简称“本基金”),是由原华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金转型而来。根据本基金的基金管理人华宝基金管理有限公司于 2026 年 1 月 8 日发布的《关于华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金变更为华宝沪深 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并修订基金合同等法律文件的公告》,自 2026 年 1 月 9 日起华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金转型为本基金,《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合同》自该日起生效,《华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于同一日失效。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定。本基金的基金管理人与注册登记机构为华宝基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金为华宝沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“目标 ETF”)的联接基金。目标 ETF 在力求有效跟踪沪深 300 指数的基础上,通过量化方法积极管理并力争获取超额收益;本基金通过投资目标 ETF,在有效跟踪标的指数基础上力争获取超越指数表现的投资收益。本基金主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪,力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.5%,年跟踪误差不超过 7.75%。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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合同》的有关规定,本基金主要投资于目标 ETF 基金份额、标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于国内依法发行上市的非成份股(包括创业板、存托凭证及其他经中国证监会允许上市的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、股指期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为:本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,持有现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。股指期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×95%＋人民币银行活期存款利率（税后）×5%。

本财务报表已于 2026 年 8 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

## 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照企业会计准则及其应用指南、准则解释及其他相关规定（包括《资产管理产品相关会计处理规定》）（以下统称企业会计准则）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》、《证券投资基金会计核算业务指引》、基金合同和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

## 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2026 年 1 月 9 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 9 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日止期间的的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

## 6.4.4 重要会计政策和会计估计

### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2026 年 1 月 9 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日。

### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种

方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资和基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的

公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1） 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2） 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1） 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2） 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3） 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4） 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5） 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。

若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交

易所上市或挂牌转让的固定收益品种，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《财政部　税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)　资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。2027 年 12 月 31 日前，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

2027 年 12 月 31 日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。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。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)　对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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市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。

(4) 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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 活期存款 | 4,862,811.08 |
| 等于：本金 | 4,862,366.01 |
| 加：应计利息 | 445.07 |
| 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 | 4,862,811.08 |

### 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 | | 1,487,354.45 | - | 7,598,408.75 | 6,111,054.30 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 21,738,895.18 | 231,133.54 | 21,948,123.54 | -21,905.18 |
| | 银行间市场 | - | - | - | - |
| | 合计 | 21,738,895.18 | 231,133.54 | 21,948,123.54 | -21,905.18 |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - |
| 基金 | | 376,317,569.96 | - | 398,819,741.30 | 22,502,171.34 |
| 其他 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 399,543,819.59 | 231,133.54 | 428,366,273.59 | 28,591,320.46 |

注：基金投资均为本基金持有的目标 ETF 的份额，按目标 ETF 于估值日的份额净值确定公允价值。

### 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 | 7,163,340.00 | - | - | - |
| 其中：股指期货投资 | 7,163,340.00 | - | - | - |
| 其他衍生工具 | - | - | - | - |
| 合计 | 7,163,340.00 | - | - | - |

### 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 |
|---|---|---|---|---|

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| IF2609 | IF2609 | 5.00 | 7,274,700.00 | 111,360.00 |
| 合计 | | | | 111,360.00 |
| 减:可抵销期货暂收款 | | | | 111,360.00 |
| 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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 15.18 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 136,789.00 |
| 其中：交易所市场 | 136,789.00 |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 76,863.46 |
| 合计 | 213,667.64 |

### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

华宝沪深 300 增强策略 ETF 发起式联接 A

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 9 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|

| | 基金份额（份） | 账面金额 |
|---|---|---|
| 基金合同生效日 | 974,300,564.88 | 974,300,564.88 |
| 2026年1月9日(基金合同生效日)至2026年6月30日基金份额折算调整 | - | - |
| 2026年1月9日(基金合同生效日)至2026年6月30日未领取红利份额折算调整 | - | - |
| 2026年1月9日(基金合同生效日)至2026年6月30日集中申购募集资金本金及利息 | - | - |
| 2026年1月9日(基金合同生效日)至2026年6月30日基金拆分和集中申购完成后 | - | - |
| 本期申购 | 24,026,359.83 | 24,026,359.83 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -729,234,639.06 | -729,234,639.06 |
| 本期末 | 269,092,285.65 | 269,092,285.65 |

华宝沪深 300 增强策略 ETF 发起式联接 C

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 9 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日 | |
|---|---|---|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 基金合同生效日 | 148,544,744.16 | 148,544,744.16 |
| 2026年1月9日(基金合同生效日)至2026年6月30日基金份额折算调整 | - | - |
| 2026年1月9日(基金合同生效日)至2026年6月30日未领取红利份额折算调整 | - | - |
| 2026年1月9日(基金合同生效日)至2026年6月30日集中申购募集资金本金及利息 | - | - |
| 2026年1月9日(基金合同生效日)至2026年6月30日基金拆分和集中申购完成后 | - | - |
| 本期申购 | 9,238,736.35 | 9,238,736.35 |

| | | |
|---|---|---|
| 本期赎回（以“-”号填列） | -140,802,929.38 | -140,802,929.38 |
| 本期末 | 16,980,551.13 | 16,980,551.13 |

## 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

华宝沪深 300 增强策略 ETF 发起式联接 A

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|---|---|---|---|
| 基金合同生效日 | 125,700,784.18 | 299,218,392.60 | 424,919,176.78 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 本期期初 | 125,700,784.18 | 299,218,392.60 | 424,919,176.78 |
| 本期利润 | 112,741,514.01 | -84,386,836.89 | 28,354,677.12 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -166,494,739.57 | -144,590,735.77 | -311,085,475.34 |
| 其中：基金申购款 | 5,922,632.58 | 4,047,324.59 | 9,969,957.17 |
| 基金赎回款 | -172,417,372.15 | -148,638,060.36 | -321,055,432.51 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 71,947,558.62 | 70,240,819.94 | 142,188,378.56 |

华宝沪深 300 增强策略 ETF 发起式联接 C

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|---|---|---|---|
| 基金合同生效日 | 12,053,799.50 | 45,099,498.07 | 57,153,297.57 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 本期期初 | 12,053,799.50 | 45,099,498.07 | 57,153,297.57 |
| 本期利润 | 15,067,294.12 | -12,984,209.12 | 2,083,085.00 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -23,525,617.04 | -27,716,631.68 | -51,242,248.72 |
| 其中：基金申购款 | 1,736,684.07 | 1,967,836.84 | 3,704,520.91 |
| 基金赎回款 | -25,262,301.11 | -29,684,468.52 | -54,946,769.63 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 3,595,476.58 | 4,398,657.27 | 7,994,133.85 |

## 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 9 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 活期存款利息收入 | 13,863.60 |
| 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 | 37,993.27 |
| 其他 | 1,169.14 |

| | |
|---|---|
| 合计 | 53,026.01 |

### 6.4.7.10 股票投资收益

#### 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026年1月9日（基金合同生效日）至2026年6月30日 |
|---|---|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 104,498,560.10 |
| 股票投资收益——赎回差价收入 | - |
| 股票投资收益——申购差价收入 | 11,903,915.83 |
| 股票投资收益——证券出借差价收入 | - |
| 合计 | 116,402,475.93 |

#### 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 9 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 卖出股票成交总额 | 1,826,708,093.07 |
| 减：卖出股票成本总额 | 1,720,748,174.86 |
| 减：交易费用 | 1,461,358.11 |
| 买卖股票差价收入 | 104,498,560.10 |

#### 6.4.7.10.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026年1月9日（基金合同生效日）至2026年6月30日 |
|---|---|
| 申购基金份额总额 | 465,563,700.00 |
| 减：现金支付申购款总额 | 176,745,884.08 |
| 减：申购股票成本总额 | 276,913,900.09 |
| 减：交易费用 | - |
| 申购差价收入 | 11,903,915.83 |

### 6.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 9 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 卖出/赎回基金成交总额 | 550,891,563.88 |
| 减：卖出/赎回基金成本总额 | 549,151,116.56 |
| 减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额 | 22,939.75 |
| 减：交易费用 | 27,416.22 |

| | |
|---|---|
| 基金投资收益 | 1,690,091.35 |

### 6.4.7.12 债券投资收益

#### 6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026年1月9日（基金合同生效日）至2026年6月30日 |
|---|---|
| 债券投资收益——利息收入 | 247,934.82 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 37,486.18 |
| 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 | 285,421.00 |

#### 6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026年1月9日（基金合同生效日）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 | 120,705,045.29 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 119,524,272.82 |
| 减：应计利息总额 | 1,143,286.29 |
| 减：交易费用 | - |
| 买卖债券差价收入 | 37,486.18 |

### 6.4.7.13 资产支持证券投资收益

#### 6.4.7.13.1 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。

### 6.4.7.14 贵金属投资收益

#### 6.4.7.14.1 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。

### 6.4.7.15 衍生工具收益

#### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

#### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 9 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 股指期货投资收益 | 9,400,290.82 |

### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 9 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 股票投资产生的股利收益 | 893,312.44 |
| 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 | 893,312.44 |

### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期<br>2026 年 1 月 9 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 1.交易性金融资产 | -88,663,589.54 |
| 股票投资 | -111,110,268.70 |
| 债券投资 | -55,492.18 |
| 资产支持证券投资 | - |
| 基金投资 | 22,502,171.34 |
| 贵金属投资 | - |
| 其他 | - |
| 2.衍生工具 | -8,707,456.47 |
| 权证投资 | - |
| 期货投资 | -8,707,456.47 |
| 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 | -97,371,046.01 |

### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 9 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 基金赎回费收入 | 4,343.53 |
| 基金转换费收入 | 2,878.77 |
| 合计 | 7,222.30 |

### 6.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 9 日（基金合同生效日）至 2026 |
|---|---|

| | 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 审计费用 | 16,588.97 |
| 信息披露费 | 56,877.21 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行费用 | 6,704.46 |
| 合计 | 80,170.64 |

## 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 |
| 中国农业银行股份有限公司("农业银行") | 基金托管人 |
| 华宝信托有限责任公司("华宝信托") | 基金管理人的股东 |
| 华平资产管理有限合伙(Warburg Pincus Asset Management.L.P.) | 基金管理人的股东 |
| 江苏省铁路集团有限公司("江苏铁集") | 基金管理人的股东 |
| 中国宝武钢铁集团有限公司("宝武集团") | 华宝信托的最终控制人 |
| 华宝证券股份有限公司("华宝证券") | 受宝武集团控制的公司,基金销售机构 |
| 华宝投资有限公司("华宝投资") | 受宝武集团控制的公司 |
| 宝武集团财务有限责任公司("宝武财务") | 受宝武集团控制的公司 |
| 华宝沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金("目标 ETF") | 本基金的基金管理人管理的其他基金 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内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<br>2026 年 1 月 9 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 743,336.15 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 740,219.15 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 3,117.00 |

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扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值后的余额的 0.8%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扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值后的余额× 0.8%/当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 9 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 92,917.01 |

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。本基金托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值后的余额的 0.1%的年费率计提。其计算公式为：

H=MAX（E×0.1%÷当年天数,0）

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值扣除前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值。

#### 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<br>2026 年 1 月 9 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日 | | |
|---|---|---|---|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 华宝沪深 300 增强策略 ETF 发起式联接 A | 华宝沪深 300 增强策略 ETF 发起式联接 C | 合计 |
| 华宝基金 | - | 1,589.52 | 1,589.52 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 华宝证券 | - | 3,329.51 | 3,329.51 |
| 合计 | - | 4,919.03 | 4,919.03 |

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

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内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<br>2026 年 1 月 9 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日 | |
|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 农业银行 | 4,862,811.08 | 13,863.60 |

注：本基金的银行存款由基金托管人农业银行保管，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

本报告期末本基金持有 365,554,300.00 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 87.55%。

除以上情况外，无其他需要说明的关联方交易事项。

## 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 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 | - |
| 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 | - |
| 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 | - |
| 688790 | 昂瑞微 | 2025 年 12 月 9 日 | 9 个月 | 新股锁定 | 83.06 | 126.45 | 2,319 | 192,616.14 | 293,237.55 | - |
| 688795 | 摩尔线程 | 2025 年 11 月 26 日 | 9 个月 | 新股锁定 | 114.28 | 676.94 | 5,660 | 646,824.80 | 3,831,480.40 | - |
| 688802 | 沐曦股份 | 2025 年 12 月 9 日 | 9 个月 | 新股锁定 | 104.66 | 768.89 | 3,994 | 418,012.04 | 3,070,946.66 | - |

### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为 ETF 联接基金，主要通过投资于目标 ETF 以达到投资目标，属于较高风险品种。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与跟踪指数相同的风险收益目标。

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在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。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

于本报告期末，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的

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

本基金所持证券均在证券交易所上市，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。本基金所持证券均在证券交易所上市，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为货币资金、结算备付金、交易性金融资产及存出保证金等

### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>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 | 4,862,811.08 | - | - | - | 4,862,811.08 |
| 结算备付金 | 3,171,450.09 | - | - | - | 3,171,450.09 |
| 存出保证金 | 585,082.67 | - | - | 872,964.00 | 1,458,046.67 |
| 交易性金融资产 | 21,948,123.54 | - | - | 406,418,150.05 | 428,366,273.59 |
| 应收申购款 | - | - | - | 267,489.97 | 267,489.97 |
| 应收清算款 | - | - | - | 175,359.24 | 175,359.24 |
| 资产总计 | 30,567,467.38 | - | - | 407,733,963.26 | 438,301,430.64 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 1,766,900.86 | 1,766,900.86 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 24,574.82 | 24,574.82 |
| 应付托管费 | - | - | - | 3,071.88 | 3,071.88 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 8,083.72 | 8,083.72 |
| 应交税费 | - | - | - | 29,782.53 | 29,782.53 |
| 其他负债 | - | - | - | 213,667.64 | 213,667.64 |
| 负债总计 | - | - | - | 2,046,081.45 | 2,046,081.45 |
| 利率敏感度缺口 | 30,567,467.38 | - | - | 405,687,881.81 | 436,255,349.19 |

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，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

### 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交易的目标 ETF 和备选成分股，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。本基金采用被动式指数化投资，主要通过投资目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股达到跟踪指数的目标。本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于该基金资产净值的 90%，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股(首次公开发行或增发等)及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的 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<br>2026 年 6 月 30 日 | |
|---|---|---|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
| 交易性金融资产－股票投资 | 7,598,408.75 | 1.74 |
| 交易性金融资产－基金投资 | 398,819,741.30 | 91.42 |
| 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 | 406,418,150.05 | 93.16 |

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)之间抵销后的净额为 0。基金投资均为本基金持有的目标 ETF 的份额，按目标 ETF 于估值日的份额净值确定公允价值。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变 | |
|---|---|---|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |

| | | |
|---|---|---|
| | | 本期末 （2026 年 6 月 30 日） |
| | 1.业绩比较基准上升 5% | 20,533,061.09 |
| | 2.业绩比较基准下降 5% | -20,533,061.09 |

## 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<br>2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 第一层次 | 398,819,741.30 |
| 第二层次 | 21,948,123.54 |
| 第三层次 | 7,598,408.75 |
| 合计 | 428,366,273.59 |

#### 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。

### 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。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2026 年 1 月 8 日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末<br>2026 年 1 月 8 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|---|
| **资 产：** | | | |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 8,377,154.11 | 1,061,667.05 |
| 结算备付金 | | 28,147,319.00 | 25,626,047.40 |
| 存出保证金 | | 14,377,482.88 | 14,021,895.82 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 1,485,325,028.35 | 1,320,028,475.76 |
| 其中：股票投资 | | 1,397,226,874.32 | 1,239,984,088.82 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 88,098,154.03 | 80,044,386.94 |
| 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 | 78,000,000.00 | 69,500,992.61 |
| 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 | | - | 3,603,574.15 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 402,137.26 | 122,590.63 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.5 | - | - |
| 资产总计 | | 1,614,629,121.60 | 1,433,965,243.42 |
| **负债和净资产** | **附注号** | **本期末<br>2026 年 1 月 8 日** | **上年度末<br>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 | | 5,025,151.11 | - |
| 应付赎回款 | | 3,204,414.09 | 3,429,245.18 |
| 应付管理人报酬 | | 328,379.97 | 1,325,683.22 |
| 应付托管费 | | 49,257.00 | 198,852.48 |
| 应付销售服务费 | | 9,724.50 | 20,547.44 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 41.43 | 29.41 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.6 | 1,094,370.11 | 1,066,936.80 |
| 负债合计 | | 9,711,338.21 | 6,041,294.53 |
| **净资产：** | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 1,122,845,309.04 | 1,015,246,872.40 |
| 其他综合收益 | | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | 482,072,474.35 | 412,677,076.49 |
| 净资产合计 | | 1,604,917,783.39 | 1,427,923,948.89 |
| 负债和净资产总计 | | 1,614,629,121.60 | 1,433,965,243.42 |

注：1.本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 01 月 08 日止。

2.报告截止日 2026 年 01 月 08 日,基金份额总额 1,122,845,309.04 份,其中华宝沪深 300 增强 A 基金份额总额 974,300,564.88 份，基金份额净值 1.4361 元；华宝沪深 300 增强 C 基金份额总额 148,544,744.16 份，基金份额净值 1.3848 元。

## 6.2 利润表

会计主体：华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 1 月 8 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 1 月 8 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|---|
| **一、营业总收入** | | 31,456,771.46 | 9,291,222.71 |
| 1.利息收入 | | 38,627.69 | 219,220.95 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 6,283.03 | 111,214.25 |
| 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 | | 32,344.66 | 108,006.70 |
| 其他利息收入 | | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 2,724.60 | 48,459,814.78 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | -29,666.98 | 40,360,324.16 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.11 | 23,155.02 | 178,977.14 |
| 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 | - | 532,890.02 |
| 股利收益 | 6.4.7.15 | 9,236.56 | 7,387,623.46 |
| 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 | 31,415,385.80 | -39,633,616.34 |
| 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 | 33.37 | 245,803.32 |
| **减：二、营业总支出** | | 390,760.03 | 4,033,910.54 |
| 1．管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 328,379.97 | 3,223,566.57 |
| 其中：暂估管理人报酬 | | - | - |
| 2．托管费 | 6.4.10.2.2 | 49,257.00 | 483,535.01 |
| 3．销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 9,724.50 | 206,105.39 |
| 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 | | 1.28 | 1,964.02 |
| 8．其他费用 | 6.4.7.20 | 3,397.28 | 118,739.55 |
| **三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）** | | 31,066,011.43 | 5,257,312.17 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** | | 31,066,011.43 | 5,257,312.17 |
| **五、其他综合收益的税后净额** | | - | - |
| **六、综合收益总额** | | 31,066,011.43 | 5,257,312.17 |

## 6.3 净资产变动表

会计主体：华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 1 月 8 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 1 月 8 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 | 1,015,246,872.40 | - | 412,677,076.49 | 1,427,923,948.89 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 1,015,246,872.40 | - | 412,677,076.49 | 1,427,923,948.89 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | 107,598,436.64 | - | 69,395,397.86 | 176,993,834.50 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 31,066,011.43 | 31,066,011.43 |
| （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） | 107,598,436.64 | - | 38,329,386.43 | 145,927,823.07 |
| 其中：1.基金申购款 | 111,556,987.37 | - | 39,996,562.21 | 151,553,549.58 |
| 2.基金赎回款 | -3,958,550.73 | - | -1,667,175.78 | -5,625,726.51 |
| （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 | 1,122,845,309.04 | - | 482,072,474.35 | 1,604,917,783.39 |
| 项目 | 上年度可比期间<br>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 | 583,727,651.73 | - | 246,808,596.85 | 830,536,248.58 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 583,727,651.73 | - | 246,808,596.85 | 830,536,248.58 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -145,589,814.17 | - | -50,861,366.86 | -196,451,181.03 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 5,257,312.17 | 5,257,312.17 |
| （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） | -145,589,814.17 | - | -56,118,679.03 | -201,708,493.20 |
| 其中：1.基金申购款 | 85,116,305.76 | - | 37,017,842.98 | 122,134,148.74 |
| 2.基金赎回款 | -230,706,119.93 | - | -93,136,522.01 | -323,842,641.94 |
| （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 | 438,137,837.56 | - | 195,947,229.99 | 634,085,067.55 |

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 | 李孟恒 | 张幸骏 |
|---|---|---|
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金（原名华宝兴业沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金，以下简称“本基金”）系由基金管理人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》、《华宝兴业沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）及其他有关法律法规的规定，经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）以证监许可[2016]2663 号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金、发起式基金，存续期限为不定期，首次设立募集基金份额为 10,000,450.05 份，经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验证，并出具了编号为德师报（验）字（16）第 0862 号的验资报告。基金合同于 2016 年 12 月 9 日正式生效。本基金的基金管理人为华宝基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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》，华宝兴业沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金于 2017 年 12 月 30 日起更名为华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金。

根据本基金的基金管理人华宝基金管理有限公司于 2026 年 1 月 8 日发布的《关于华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金变更为华宝沪深 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并修订基金合同等法律文件的公告》，自 2026 年 1 月 9 日起本基金转型为华宝沪深 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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及《华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》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、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（含国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。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。

根据《华宝基金管理有限公司关于华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同的公告》，自 2019 年 5 月 24 日起，增设 C 类基金份额。增加 C 类基金份额

后，本基金原有基金份额为 A 类基金份额。本基金根据销售服务费及申购费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。不从本类别基金资产中计提销售服务费，且收取申购费的基金份额类别为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费，且不收取申购费的基金份额类别为 C 类基金份额。两类基金份额分设不同的基金代码，并分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于沪深 300 指数成分股及备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终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%。本基金投资股指期货、权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×95%+1.5%（指年收益率，评价时按期间折算）

本财务报表已于 2026 年 8 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照企业会计准则及其应用指南、准则解释及其他相关规定（包括《资产管理产品相关会计处理规定》）（以下统称企业会计准则）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》、《证券投资基金会计核算业务指引》、基金合同和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 1 月 8 日（基金合同失效前日）的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 1 月 8 日（基金合同失效前日）止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《财政部　税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)　资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。2027 年 12 月 31 日前，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

2027 年 12 月 31 日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。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。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)　对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。

(3)　对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市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。

(4) 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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2026 年 1 月 8 日 |
|---|---|
| 活期存款 | 8,377,154.11 |
| 等于：本金 | 8,375,917.31 |
| 加：应计利息 | 1,236.80 |
| 减：坏账准备 | - |
| 定期存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | - |
| 存款期限 1-3 个月 | - |
| 存款期限 3 个月以上 | - |
| - | - |
| 其他存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 合计 | 8,377,154.11 |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末<br>2026 年 1 月 8 日 | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 1,280,005,551.32 | - | 1,397,226,874.32 | 117,221,323.00 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 87,199,643.00 | 864,924.03 | 88,098,154.03 | 33,587.00 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | 银行间市场 | - | - | - | - |
| | 合计 | 87,199,643.00 | 864,924.03 | 88,098,154.03 | 33,587.00 |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 1,367,205,194.32 | 864,924.03 | 1,485,325,028.35 | 117,254,910.00 |

## 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 1 月 8 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 | 107,221,603.53 | - | - | - |
| 其中：股指期货投资 | 107,221,603.53 | - | - | - |
| 其他衍生工具 | - | - | - | - |
| 合计 | 107,221,603.53 | - | - | - |

### 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 |
|---|---|---|---|---|
| IF2601 | IF2601 | 25.00 | 35,496,000.00 | 1,487,426.20 |
| IF2603 | IF2603 | 57.00 | 80,544,420.00 | 7,331,390.27 |
| 合计 | | | | 8,818,816.47 |
| 减:可抵销期货暂收款 | | | | 8,818,816.47 |
| 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<br>2026 年 1 月 8 日 | |
|---|---|---|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 78,000,000.00 | - |
| 银行间市场 | - | - |
| 合计 | 78,000,000.00 | - |

#### 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<br>2026 年 1 月 8 日 |
|---|---|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 116.30 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 935,856.53 |
| 其中：交易所市场 | 935,856.53 |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 158,397.28 |
| 合计 | 1,094,370.11 |

### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

华宝沪深 300 增强 A

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 1 月 8 日 | |
|---|---|---|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 976,221,781.17 | 976,221,781.17 |
| 本期申购 | 583,462.04 | 583,462.04 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -2,504,678.33 | -2,504,678.33 |
| 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 | 974,300,564.88 | 974,300,564.88 |

华宝沪深 300 增强 C

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 1 月 8 日 | |
|---|---|---|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 39,025,091.23 | 39,025,091.23 |
| 本期申购 | 110,973,525.33 | 110,973,525.33 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1,453,872.40 | -1,453,872.40 |
| 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 | 148,544,744.16 | 148,544,744.16 |

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

华宝沪深 300 增强 A

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|---|---|---|---|
| 上年度末 | 126,258,581.50 | 272,448,233.75 | 398,706,815.25 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 本期期初 | 126,258,581.50 | 272,448,233.75 | 398,706,815.25 |
| 本期利润 | -309,775.37 | 27,373,597.71 | 27,063,822.34 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -248,021.95 | -603,438.86 | -851,460.81 |
| 其中：基金申购款 | 75,370.82 | 178,471.16 | 253,841.98 |
| 基金赎回款 | -323,392.77 | -781,910.02 | -1,105,302.79 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 125,700,784.18 | 299,218,392.60 | 424,919,176.78 |

华宝沪深 300 增强 C

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|---|---|---|---|
| 上年度末 | 3,176,670.74 | 10,793,590.50 | 13,970,261.24 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 本期期初 | 3,176,670.74 | 10,793,590.50 | 13,970,261.24 |
| 本期利润 | -39,599.00 | 4,041,788.09 | 4,002,189.09 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 8,916,727.76 | 30,264,119.48 | 39,180,847.24 |
| 其中：基金申购款 | 9,034,892.58 | 30,707,827.65 | 39,742,720.23 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 基金赎回款 | -118,164.82 | -443,708.17 | -561,872.99 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 12,053,799.50 | 45,099,498.07 | 57,153,297.57 |

### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 1 月 8 日 |
|---|---|
| 活期存款利息收入 | 319.65 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 5,615.60 |
| 其他 | 347.78 |
| 合计 | 6,283.03 |

### 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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 1 月 8 日 |
|---|---|
| 卖出股票成交总额 | 4,046.70 |
| 减：卖出股票成本总额 | 1,543.48 |
| 减：交易费用 | 32,170.20 |
| 买卖股票差价收入 | -29,666.98 |

### 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<br>2026年1月1日至2026年1月8日 |
|---|---|
| 债券投资收益——利息收入 | 23,155.02 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | - |
| 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 | 23,155.02 |

### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

### 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

本基金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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 1 月 8 日 |
|---|---|
| 股票投资产生的股利收益 | 9,236.56 |
| 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 | 9,236.56 |

### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 1 月 8 日 |
|---|---|
| 1.交易性金融资产 | 28,556,685.80 |
| 股票投资 | 28,554,885.80 |
| 债券投资 | 1,800.00 |
| 资产支持证券投资 | - |
| 基金投资 | - |
| 贵金属投资 | - |
| 其他 | - |
| 2.衍生工具 | 2,858,700.00 |
| 权证投资 | - |
| 期货投资 | 2,858,700.00 |
| 3.其他 | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | - |
| 合计 | 31,415,385.80 |

### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 1 月 8 日 |
|---|---|
| 基金赎回费收入 | 33.37 |
| 合计 | 33.37 |

### 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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 1 月 8 日 |
|---|---|
| 审计费用 | 767.12 |
| 信息披露费 | 2,630.16 |
| 证券出借违约金 | - |
| 合计 | 3,397.28 |

## 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 |
| 中国农业银行股份有限公司("农业银行") | 基金托管人 |
| 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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 1 月 8 日 | 上年度可比期间<br>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 | 328,379.97 | 3,223,566.57 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 87,937.81 | 681,013.48 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 240,442.16 | 2,542,553.09 |

注：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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 1 月 8 日 | 上年度可比期间<br>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 | 49,257.00 | 483,535.01 |

注：支付基金托管人中国农业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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 1 月 8 日 | | |
|---|---|---|---|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 华宝沪深 300 增强 A | 华宝沪深 300 增强 C | 合计 |
| 华宝基金 | - | 85.67 | 85.67 |
| 华宝证券 | - | 153.81 | 153.81 |
| 合计 | - | 239.48 | 239.48 |

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>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 | | |
| | 华宝沪深 300 增强 A | 华宝沪深 300 增强 C | 合计 |
| 华宝基金 | - | 119,781.17 | 119,781.17 |
| 华宝证券 | - | 4,671.08 | 4,671.08 |
| 合计 | - | 124,452.25 | 124,452.25 |

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

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

### 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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 1 月 8 日 | 上年度可比期间<br>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 |
|---|---|---|---|---|
| 农业银行 | 8,377,154.11 | 319.65 | 1,609,561.63 | 9,548.12 |

注：本基金的银行存款由基金托管人农业银行保管，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 1 月 8 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 001221 | 悍高集团 | 2025 年 7 月 23 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 15.43 | 58.39 | 160 | 2,468.80 | 9,342.40 | - |
| 001233 | 海安集团 | 2025 年 11 月 18 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 48.00 | 56.22 | 370 | 17,760.00 | 20,801.40 | - |
| 001280 | 中国铀业 | 2025 年 11 月 25 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 17.89 | 47.37 | 2,277 | 40,735.53 | 107,861.49 | - |
| 001285 | 瑞立科密 | 2025 年 9 月 23 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 42.28 | 58.55 | 137 | 5,792.36 | 8,021.35 | - |
| 001369 | 双欣材料 | 2025 年 12 月 23 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 6.85 | 11.83 | 897 | 6,144.45 | 10,611.51 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 001386 | 马可波罗 | 2025 年 10 月 15 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 13.75 | 19.05 | 1,626 | 22,357.50 | 30,975.30 | - |
| 001396 | 誉帆科技 | 2025 年 12 月 23 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 22.29 | 33.07 | 69 | 1,538.01 | 2,281.83 | - |
| 301449 | 天溯计量 | 2025 年 12 月 16 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 36.80 | 65.56 | 112 | 4,121.60 | 7,342.72 | - |
| 301491 | 汉桑科技 | 2025 年 7 月 29 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 28.91 | 57.70 | 245 | 7,082.95 | 14,136.50 | - |
| 301563 | 云汉芯城 | 2025 年 9 月 23 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 27.00 | 164.22 | 110 | 2,970.00 | 18,064.20 | - |
| 301575 | 艾芬达 | 2025 年 9 月 3 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 27.69 | 49.33 | 126 | 3,488.94 | 6,215.58 | - |
| 301584 | 建发致新 | 2025 年 9 月 18 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 7.05 | 28.38 | 447 | 3,151.35 | 12,685.86 | - |
| 301609 | 山大电力 | 2025 年 7 月 16 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 14.66 | 43.05 | 277 | 4,060.82 | 11,924.85 | - |
| 301632 | 广东建科 | 2025 年 8 月 5 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 6.56 | 24.43 | 656 | 4,303.36 | 16,026.08 | - |
| 301638 | 南网数字 | 2025 年 11 月 11 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 5.69 | 15.32 | 2,322 | 13,212.18 | 35,573.04 | - |
| 301656 | 联合动力 | 2025 年 9 月 17 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 12.48 | 26.47 | 7,025 | 87,672.00 | 185,951.75 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 301667 | 纳百川 | 2025 年 12 月 10 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 22.63 | 55.49 | 151 | 3,417.13 | 8,378.99 | - |
| 301668 | 昊创瑞通 | 2025 年 9 月 15 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 21.00 | 48.35 | 165 | 3,465.00 | 7,977.75 | - |
| 301687 | 新广益 | 2025 年 12 月 24 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 21.93 | 51.72 | 195 | 4,276.35 | 10,085.40 | - |
| 600930 | 华电新能 | 2025 年 7 月 9 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 3.18 | 6.33 | 99,713 | 317,087.34 | 631,183.29 | - |
| 601026 | 道生天合 | 2025 年 10 月 9 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 5.98 | 14.65 | 451 | 2,696.98 | 6,607.15 | - |
| 603092 | 德力佳 | 2025 年 10 月 30 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 46.68 | 59.62 | 146 | 6,815.28 | 8,704.52 | - |
| 603175 | 超颖电子 | 2025 年 10 月 17 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 17.08 | 52.91 | 169 | 2,886.52 | 8,941.79 | - |
| 603248 | 锡华科技 | 2025 年 12 月 16 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 10.10 | 16.86 | 260 | 2,626.00 | 4,383.60 | - |
| 603262 | 技源集团 | 2025 年 7 月 16 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 10.88 | 28.79 | 155 | 1,686.40 | 4,462.45 | - |
| 603334 | 丰倍生物 | 2025 年 10 月 29 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 24.49 | 34.95 | 88 | 2,155.12 | 3,075.60 | - |
| 603352 | 至信股份 | 2026 年 1 月 8 日 | 1 个月内（含） | 新股流通 | 21.88 | 21.88 | 1,003 | 21,945.64 | 21,945.64 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | | 受限 | | | | | | |
| 603352 | 至信股份 | 2026 年 1 月 8 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 21.88 | 21.88 | 112 | 2,450.56 | 2,450.56 | - |
| 603370 | 华新精科 | 2025 年 8 月 27 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 18.60 | 47.27 | 82 | 1,525.20 | 3,876.14 | - |
| 603376 | 大明电子 | 2025 年 10 月 28 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 12.55 | 26.96 | 111 | 1,393.05 | 2,992.56 | - |
| 603406 | 天富龙 | 2025 年 7 月 30 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 23.60 | 39.57 | 153 | 3,610.80 | 6,054.21 | - |
| 603418 | 友升股份 | 2025 年 9 月 16 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 46.36 | 57.49 | 139 | 6,444.04 | 7,991.11 | - |
| 688759 | 必贝特 | 2025 年 10 月 21 日 | 9 个月 | 新股锁定 | 17.78 | 42.36 | 12,552 | 223,174.56 | 531,702.72 | - |
| 688790 | 昂瑞微 | 2025 年 12 月 9 日 | 9 个月 | 新股锁定 | 83.06 | 131.48 | 2,319 | 192,616.14 | 304,902.12 | - |
| 688795 | 摩尔线程 | 2025 年 11 月 26 日 | 9 个月 | 新股锁定 | 114.28 | 476.94 | 5,660 | 646,824.80 | 2,699,480.40 | - |
| 688796 | 百奥赛图 | 2025 年 12 月 2 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 26.68 | 45.01 | 423 | 11,285.64 | 19,039.23 | - |
| 688802 | 沐曦股份 | 2025 年 12 月 9 日 | 9 个月 | 新股锁定 | 104.66 | 442.13 | 3,994 | 418,012.04 | 1,765,867.22 | - |
| 688805 | 健信 | 2025 年 12 | 6 个月 | 新股 | 18.58 | 35.37 | 265 | 4,923.70 | 9,373.05 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 超导 | 月 17 日 | | 锁定 | | | | | | |
| 688807 | 优迅股份 | 2025 年 12 月 10 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 51.66 | 141.52 | 131 | 6,767.46 | 18,539.12 | - |
| 688809 | 强一股份 | 2025 年 12 月 23 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 85.09 | 254.90 | 259 | 22,038.31 | 66,019.10 | - |

### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量（股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 002049 | 紫光国微 | 2025 年 12 月 30 日 | 重大事项停牌 | 78.81 | 2026 年 1 月 15 日 | 86.69 | 111,420 | 8,822,124.44 | 8,781,010.20 | - |

### 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

本基金为指数增强型股票基金，在实现对沪深 300 指数有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的组合配置和管理，力争实现稳定的优于标的指数的投资收益，追求基金资产的长期增值。本基金属于高预期风险、高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。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在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，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金所持证券均在证券交易所上市，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。本基金所持证券均在证券交易所上市，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、交易性金融资产及存出保证金等

### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2026 年 1 月 8 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|---|---|---|---|---|---|
| 资产 | | | | | |
| 货币资金 | 8,377,154.11 | - | - | - | 8,377,154.11 |
| 结算备付金 | 28,147,319.00 | - | - | - | 28,147,319.00 |
| 存出保证金 | 452,632.48 | - | - | 13,924,850.40 | 14,377,482.88 |
| 交易性金融资产 | 88,098,154.03 | - | - | 1,397,226,874.32 | 1,485,325,028.35 |
| 买入返售金融资产 | 78,000,000.00 | - | - | - | 78,000,000.00 |
| 应收申购款 | - | - | - | 402,137.26 | 402,137.26 |
| 资产总计 | 203,075,259.62 | - | - | 1,411,553,861.98 | 1,614,629,121.60 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 3,204,414.09 | 3,204,414.09 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 328,379.97 | 328,379.97 |
| 应付托管费 | - | - | - | 49,257.00 | 49,257.00 |
| 应付清算款 | - | - | - | 5,025,151.11 | 5,025,151.11 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 9,724.50 | 9,724.50 |
| 应交税费 | - | - | - | 41.43 | 41.43 |
| 其他负债 | - | - | - | 1,094,370.11 | 1,094,370.11 |
| 负债总计 | - | - | - | 9,711,338.21 | 9,711,338.21 |
| 利率敏感度缺口 | 203,075,259.62 | - | - | 1,401,842,523.77 | 1,604,917,783.39 |
| 上年度末<br>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 | 1,061,667.05 | - | - | - | 1,061,667.05 |
| 结算备付金 | 25,626,047.40 | - | - | - | 25,626,047.40 |
| 存出保证金 | 440,089.42 | - | - | 13,581,806.40 | 14,021,895.82 |
| 交易性金融资产 | 80,044,386.94 | - | - | 1,239,984,088.82 | 1,320,028,475.76 |
| 买入返售金融资产 | 69,500,992.61 | - | - | - | 69,500,992.61 |
| 应收申购款 | - | - | - | 122,590.63 | 122,590.63 |
| 应收清算款 | - | - | - | 3,603,574.15 | 3,603,574.15 |
| 资产总计 | 176,673,183.42 | - | - | 1,257,292,060.00 | 1,433,965,243.42 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 3,429,245.18 | 3,429,245.18 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 1,325,683.22 | 1,325,683.22 |
| 应付托管费 | - | - | - | 198,852.48 | 198,852.48 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 20,547.44 | 20,547.44 |
| 应交税费 | - | - | - | 29.41 | 29.41 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 其他负债 | - | - | - | 1,066,936.80 | 1,066,936.80 |
| 负债总计 | - | - | - | 6,041,294.53 | 6,041,294.53 |
| 利率敏感度缺口 | 176,673,183.42 | - | - | 1,251,250,765.47 | 1,427,923,948.89 |

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。

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：本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%,其中投资于沪深 300 指数成分股及备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终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%。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<br>2026 年 1 月 8 日 | | 上年度末<br>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 | 1,397,226,874.32 | 87.06 | 1,239,984,088.82 | 86.84 |
| 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 | 1,397,226,874.32 | 87.06 | 1,239,984,088.82 | 86.84 |

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 | 除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变 | | |
|---|---|---|---|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末 （2026 年 1 月 8 日） | 上年度末 （2025 年 12 月 31 日 ） |
| | 1.业绩比较基准上升 5% | 76,561,577.90 | 68,371,740.65 |
| | 2.业绩比较基准下降 5% | -76,561,577.90 | -68,371,740.65 |

## 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<br>2026 年 1 月 8 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 第一层次 | 1,381,794,014.54 | 1,219,373,534.58 |
| 第二层次 | 96,903,560.43 | 94,837,208.39 |
| 第三层次 | 6,627,453.38 | 5,817,732.79 |
| 合计 | 1,485,325,028.35 | 1,320,028,475.76 |

#### 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（转型后）

### 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 | 7,598,408.75 | 1.73 |
| | 其中：股票 | 7,598,408.75 | 1.73 |
| 2 | 基金投资 | 398,819,741.30 | 90.99 |
| 3 | 固定收益投资 | 21,948,123.54 | 5.01 |
| | 其中：债券 | 21,948,123.54 | 5.01 |
| | 资产支持证券 | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 8,034,261.17 | 1.83 |
| 8 | 其他各项资产 | 1,900,895.88 | 0.43 |
| 9 | 合计 | 438,301,430.64 | 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 | - | - |
| C | 制造业 | 7,598,408.75 | 1.74 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | - | - |
| 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 | - | - |
| 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 | 7,598,408.75 | 1.74 |

### 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 | 688795 | 摩尔线程 | 5,660 | 3,831,480.40 | 0.88 |
| 2 | 688802 | 沐曦股份 | 3,994 | 3,070,946.66 | 0.70 |
| 3 | 688759 | 必贝特 | 12,552 | 384,718.80 | 0.09 |
| 4 | 688790 | 昂瑞微 | 2,319 | 293,237.55 | 0.07 |
| 5 | 301687 | 新广益 | 195 | 15,167.10 | 0.00 |
| 6 | 603352 | 至信股份 | 112 | 2,858.24 | 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末基金资产净值 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 | 占期末基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 688111 | 金山办公 | 11,694,043.90 | 2.68 |
| 2 | 000408 | 藏格矿业 | 10,496,418.08 | 2.41 |
| 3 | 603799 | 华友钴业 | 8,970,933.65 | 2.06 |
| 4 | 300759 | 康龙化成 | 8,368,997.00 | 1.92 |
| 5 | 601229 | 上海银行 | 8,246,077.00 | 1.89 |
| 6 | 300476 | 胜宏科技 | 7,492,559.00 | 1.72 |
| 7 | 688256 | 寒武纪 | 7,209,985.94 | 1.65 |
| 8 | 601058 | 赛轮轮胎 | 7,155,085.00 | 1.64 |
| 9 | 601898 | 中煤能源 | 7,079,710.00 | 1.62 |
| 10 | 600585 | 海螺水泥 | 6,708,512.00 | 1.54 |
| 11 | 601808 | 中海油服 | 6,687,337.00 | 1.53 |
| 12 | 300033 | 同花顺 | 6,589,187.00 | 1.51 |
| 13 | 002916 | 深南电路 | 6,382,430.00 | 1.46 |
| 14 | 601901 | 方正证券 | 6,232,322.00 | 1.43 |
| 15 | 000100 | TCL 科技 | 6,149,492.00 | 1.41 |
| 16 | 600941 | 中国移动 | 6,141,596.00 | 1.41 |
| 17 | 003816 | 中国广核 | 6,031,619.00 | 1.38 |
| 18 | 600415 | 小商品城 | 5,857,290.00 | 1.34 |
| 19 | 601998 | 中信银行 | 5,762,326.00 | 1.32 |
| 20 | 600150 | 中国船舶 | 5,643,633.03 | 1.29 |

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末基金资产净值 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 | 占期末基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 300750 | 宁德时代 | 54,048,101.03 | 12.39 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 51,628,656.50 | 11.83 |
| 3 | 601899 | 紫金矿业 | 44,228,856.00 | 10.14 |
| 4 | 601318 | 中国平安 | 42,604,499.28 | 9.77 |
| 5 | 600036 | 招商银行 | 32,055,859.54 | 7.35 |
| 6 | 300308 | 中际旭创 | 28,186,646.00 | 6.46 |
| 7 | 601166 | 兴业银行 | 27,383,556.05 | 6.28 |
| 8 | 603259 | 药明康德 | 22,956,895.00 | 5.26 |
| 9 | 300502 | 新易盛 | 22,924,250.58 | 5.25 |
| 10 | 000333 | 美的集团 | 20,856,876.22 | 4.78 |
| 11 | 002475 | 立讯精密 | 20,586,735.92 | 4.72 |
| 12 | 600150 | 中国船舶 | 19,964,167.82 | 4.58 |
| 13 | 300274 | 阳光电源 | 18,699,893.00 | 4.29 |
| 14 | 600030 | 中信证券 | 18,423,597.00 | 4.22 |
| 15 | 688256 | 寒武纪 | 17,531,823.81 | 4.02 |
| 16 | 603993 | 洛阳钼业 | 16,507,078.00 | 3.78 |
| 17 | 601138 | 工业富联 | 15,774,401.00 | 3.62 |
| 18 | 601117 | 中国化学 | 15,178,718.00 | 3.48 |
| 19 | 600887 | 伊利股份 | 15,061,762.90 | 3.45 |
| 20 | 000408 | 藏格矿业 | 14,981,901.00 | 3.43 |
| 21 | 601225 | 陕西煤业 | 14,954,086.80 | 3.43 |
| 22 | 603501 | 豪威集团 | 14,938,441.70 | 3.42 |
| 23 | 600941 | 中国移动 | 14,754,035.78 | 3.38 |
| 24 | 600900 | 长江电力 | 14,578,175.00 | 3.34 |
| 25 | 002916 | 深南电路 | 14,513,167.00 | 3.33 |
| 26 | 600690 | 海尔智家 | 14,389,554.79 | 3.30 |
| 27 | 600919 | 江苏银行 | 14,346,092.00 | 3.29 |
| 28 | 603799 | 华友钴业 | 14,334,838.20 | 3.29 |
| 29 | 002028 | 思源电气 | 14,261,854.00 | 3.27 |
| 30 | 300033 | 同花顺 | 14,223,218.73 | 3.26 |
| 31 | 000338 | 潍柴动力 | 14,204,577.80 | 3.26 |
| 32 | 002415 | 海康威视 | 14,086,894.00 | 3.23 |
| 33 | 601398 | 工商银行 | 13,598,973.00 | 3.12 |
| 34 | 600183 | 生益科技 | 13,260,126.00 | 3.04 |
| 35 | 601328 | 交通银行 | 13,209,693.00 | 3.03 |
| 36 | 688111 | 金山办公 | 13,175,821.20 | 3.02 |
| 37 | 002027 | 分众传媒 | 13,008,126.00 | 2.98 |
| 38 | 000100 | TCL 科技 | 12,896,336.00 | 2.96 |
| 39 | 601919 | 中远海控 | 12,767,384.98 | 2.93 |
| 40 | 601808 | 中海油服 | 12,618,691.98 | 2.89 |
| 41 | 600741 | 华域汽车 | 12,531,206.50 | 2.87 |
| 42 | 000157 | 中联重科 | 12,328,221.00 | 2.83 |
| 43 | 688981 | 中芯国际 | 12,327,072.38 | 2.83 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 44 | 688041 | 海光信息 | 12,260,957.72 | 2.81 |
| 45 | 000651 | 格力电器 | 12,218,943.98 | 2.80 |
| 46 | 600415 | 小商品城 | 12,033,177.04 | 2.76 |
| 47 | 002236 | 大华股份 | 12,028,090.60 | 2.76 |
| 48 | 002074 | 国轩高科 | 11,870,119.00 | 2.72 |
| 49 | 300628 | 亿联网络 | 11,669,984.86 | 2.68 |
| 50 | 000792 | 盐湖股份 | 11,461,676.00 | 2.63 |
| 51 | 601872 | 招商轮船 | 11,422,525.54 | 2.62 |
| 52 | 600066 | 宇通客车 | 11,405,947.00 | 2.61 |
| 53 | 300759 | 康龙化成 | 11,369,367.50 | 2.61 |
| 54 | 002142 | 宁波银行 | 11,346,979.00 | 2.60 |
| 55 | 601901 | 方正证券 | 11,333,240.00 | 2.60 |
| 56 | 601939 | 建设银行 | 11,300,147.00 | 2.59 |
| 57 | 600989 | 宝丰能源 | 11,280,703.00 | 2.59 |
| 58 | 300347 | 泰格医药 | 11,254,121.00 | 2.58 |
| 59 | 601857 | 中国石油 | 11,140,181.50 | 2.55 |
| 60 | 002049 | 紫光国微 | 11,022,644.60 | 2.53 |
| 61 | 600999 | 招商证券 | 10,942,227.24 | 2.51 |
| 62 | 002001 | 新 和 成 | 10,933,573.80 | 2.51 |
| 63 | 000708 | 中信特钢 | 10,728,222.00 | 2.46 |
| 64 | 600039 | 四川路桥 | 10,663,835.00 | 2.44 |
| 65 | 600938 | 中国海油 | 10,620,455.00 | 2.43 |
| 66 | 300442 | 润泽科技 | 10,618,093.34 | 2.43 |
| 67 | 600276 | 恒瑞医药 | 10,570,679.29 | 2.42 |
| 68 | 600219 | 南山铝业 | 10,528,356.00 | 2.41 |
| 69 | 000568 | 泸州老窖 | 10,444,737.54 | 2.39 |
| 70 | 000895 | 双汇发展 | 10,186,876.50 | 2.34 |
| 71 | 000001 | 平安银行 | 10,054,910.00 | 2.30 |
| 72 | 603296 | 华勤技术 | 9,991,520.51 | 2.29 |
| 73 | 000166 | 申万宏源 | 9,646,485.00 | 2.21 |
| 74 | 601058 | 赛轮轮胎 | 9,614,479.31 | 2.20 |
| 75 | 300476 | 胜宏科技 | 9,587,410.02 | 2.20 |
| 76 | 000963 | 华东医药 | 9,255,186.58 | 2.12 |
| 77 | 601881 | 中国银河 | 9,153,584.00 | 2.10 |
| 78 | 002594 | 比亚迪 | 9,152,646.00 | 2.10 |
| 79 | 688012 | 中微公司 | 9,032,199.53 | 2.07 |
| 80 | 002463 | 沪电股份 | 8,990,994.00 | 2.06 |
| 81 | 601229 | 上海银行 | 8,833,921.34 | 2.02 |
| 82 | 601728 | 中国电信 | 8,809,748.00 | 2.02 |
| 83 | 600585 | 海螺水泥 | 8,768,808.00 | 2.01 |
| 84 | 601877 | 正泰电器 | 8,736,041.00 | 2.00 |

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 | 391,655,261.68 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,826,708,093.07 |

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 | 21,948,123.54 | 5.03 |
| 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 | 21,948,123.54 | 5.03 |

### 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 | 197,000 | 19,906,698.88 | 4.56 |
| 2 | 102245 | 国债 2317 | 20,000 | 2,041,424.66 | 0.47 |

### 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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 基金名称 | 基金类型 | 运作方式 | 管理人 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 华宝沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 | 指数基金 | 交易型开放式 | 华宝基金管理有限公司 | 398,819,741.30 | 91.42 |

## 7.11 本基金投资股指期货的投资政策

本基金主要利用股指期货提高投资效率，以更好地实现本基金的投资目标，降低跟踪误差。此外，在预期大额申购赎回、大额分红等情形发生时，本基金可以通过股指期货进行有效的现金头寸管理。

本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，并符合既定的投资政策和投资目标。

## 7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.12.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

### 7.12.2 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

## 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

基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚，无证券投资决策程序需特别说明。

### 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 | 1,458,046.67 |
| 2 | 应收清算款 | 175,359.24 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 267,489.97 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,900,895.88 |

### 7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 688795 | 摩尔线程 | 3,831,480.40 | 0.88 | 新股锁定 |
| 2 | 688802 | 沐曦股份 | 3,070,946.66 | 0.70 | 新股锁定 |
| 3 | 688759 | 必贝特 | 384,718.80 | 0.09 | 新股锁定 |
| 4 | 688790 | 昂瑞微 | 293,237.55 | 0.07 | 新股锁定 |
| 5 | 301687 | 新广益 | 15,167.10 | 0.00 | 新股锁定 |
| 6 | 603352 | 至信股份 | 2,858.24 | 0.00 | 新股锁定 |

### 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。

## §7 投资组合报告（转型前）

### 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 | 1,397,226,874.32 | 86.54 |
| | 其中：股票 | 1,397,226,874.32 | 86.54 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 88,098,154.03 | 5.46 |
| | 其中：债券 | 88,098,154.03 | 5.46 |
| | 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 | 78,000,000.00 | 4.83 |
| | 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 | 36,524,473.11 | 2.26 |
| 8 | 其他各项资产 | 14,779,620.14 | 0.92 |
| 9 | 合计 | 1,614,629,121.60 | 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 报告期末指数投资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 | 5,513,168.00 | 0.34 |
| B | 采矿业 | 103,450,752.40 | 6.45 |
| C | 制造业 | 741,187,392.67 | 46.18 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 39,454,995.41 | 2.46 |
| E | 建筑业 | 24,582,434.00 | 1.53 |
| F | 批发和零售业 | 8,438,587.05 | 0.53 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 39,121,816.00 | 2.44 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 58,296,497.52 | 3.63 |
| J | 金融业 | 302,557,863.84 | 18.85 |
| K | 房地产业 | 5,858,898.00 | 0.37 |
| L | 租赁和商务服务业 | 18,099,427.14 | 1.13 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 30,968,525.00 | 1.93 |
| 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 | 1,377,530,357.03 | 85.83 |

### 7.2.2 报告期末积极投资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 | 107,861.49 | 0.01 |
| C | 制造业 | 15,846,878.84 | 0.99 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 1,859,882.06 | 0.12 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 1,837,205.04 | 0.11 |
| J | 金融业 | - | - |
| 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 | 44,689.86 | 0.00 |
| 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 | 19,696,517.29 | 1.23 |

### 7.2.3 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

### 7.3.1 期末指数投资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 | 300750 | 宁德时代 | 155,590 | 57,445,383.90 | 3.58 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 32,800 | 46,323,440.00 | 2.89 |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 630,224 | 44,355,165.12 | 2.76 |
| 4 | 601899 | 紫金矿业 | 1,073,100 | 38,953,530.00 | 2.43 |
| 5 | 600036 | 招商银行 | 776,928 | 32,304,666.24 | 2.01 |
| 6 | 300308 | 中际旭创 | 46,000 | 27,390,700.00 | 1.71 |
| 7 | 601166 | 兴业银行 | 1,252,200 | 26,196,024.00 | 1.63 |
| 8 | 000333 | 美的集团 | 268,800 | 21,243,264.00 | 1.32 |
| 9 | 300502 | 新易盛 | 50,700 | 20,804,238.00 | 1.30 |
| 10 | 002475 | 立讯精密 | 367,100 | 20,249,236.00 | 1.26 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 11 | 603259 | 药明康德 | 203,100 | 19,938,327.00 | 1.24 |
| 12 | 600030 | 中信证券 | 664,300 | 18,959,122.00 | 1.18 |
| 13 | 601138 | 工业富联 | 277,500 | 17,019,075.00 | 1.06 |
| 14 | 300274 | 阳光电源 | 94,620 | 16,175,289.00 | 1.01 |
| 15 | 600150 | 中国船舶 | 432,950 | 15,534,246.00 | 0.97 |
| 16 | 600887 | 伊利股份 | 569,341 | 15,520,235.66 | 0.97 |
| 17 | 601328 | 交通银行 | 2,005,700 | 14,220,413.00 | 0.89 |
| 18 | 603993 | 洛阳钼业 | 653,500 | 14,167,880.00 | 0.88 |
| 19 | 600900 | 长江电力 | 495,600 | 13,510,056.00 | 0.84 |
| 20 | 600919 | 江苏银行 | 1,275,800 | 13,421,416.00 | 0.84 |
| 21 | 601398 | 工商银行 | 1,674,600 | 12,877,674.00 | 0.80 |
| 22 | 601919 | 中远海控 | 846,600 | 12,563,544.00 | 0.78 |
| 23 | 002415 | 海康威视 | 413,900 | 12,421,139.00 | 0.77 |
| 24 | 000651 | 格力电器 | 303,900 | 12,289,716.00 | 0.77 |
| 25 | 601225 | 陕西煤业 | 542,400 | 12,193,152.00 | 0.76 |
| 26 | 600690 | 海尔智家 | 460,600 | 12,030,872.00 | 0.75 |
| 27 | 600183 | 生益科技 | 165,400 | 11,816,176.00 | 0.74 |
| 28 | 688256 | 寒武纪 | 8,065 | 11,645,860.00 | 0.73 |
| 29 | 000338 | 潍柴动力 | 652,000 | 11,462,160.00 | 0.71 |
| 30 | 002142 | 宁波银行 | 387,600 | 11,116,368.00 | 0.69 |
| 31 | 600276 | 恒瑞医药 | 172,000 | 10,939,200.00 | 0.68 |
| 32 | 601939 | 建设银行 | 1,157,500 | 10,521,675.00 | 0.66 |
| 33 | 600999 | 招商证券 | 606,700 | 10,398,838.00 | 0.65 |
| 34 | 000001 | 平安银行 | 900,800 | 10,368,208.00 | 0.65 |
| 35 | 688981 | 中芯国际 | 79,115 | 10,296,817.25 | 0.64 |
| 36 | 600989 | 宝丰能源 | 506,600 | 10,253,584.00 | 0.64 |
| 37 | 002236 | 大华股份 | 529,308 | 10,210,351.32 | 0.64 |
| 38 | 600219 | 南山铝业 | 1,764,600 | 10,128,804.00 | 0.63 |
| 39 | 601117 | 中国化学 | 1,215,300 | 9,953,307.00 | 0.62 |
| 40 | 601857 | 中国石油 | 1,006,700 | 9,865,660.00 | 0.61 |
| 41 | 600941 | 中国移动 | 96,100 | 9,621,532.00 | 0.60 |
| 42 | 002594 | 比亚迪 | 96,100 | 9,310,168.00 | 0.58 |
| 43 | 002001 | 新 和 成 | 347,380 | 9,011,037.20 | 0.56 |
| 44 | 002027 | 分众传媒 | 1,167,700 | 8,897,874.00 | 0.55 |
| 45 | 300059 | 东方财富 | 366,804 | 8,803,296.00 | 0.55 |
| 46 | 002049 | 紫光国微 | 111,420 | 8,781,010.20 | 0.55 |
| 47 | 603501 | 豪威集团 | 66,370 | 8,751,548.20 | 0.55 |
| 48 | 601872 | 招商轮船 | 907,280 | 8,709,888.00 | 0.54 |
| 49 | 002463 | 沪电股份 | 119,900 | 8,540,477.00 | 0.53 |
| 50 | 002311 | 海大集团 | 157,839 | 8,363,888.61 | 0.52 |
| 51 | 600741 | 华域汽车 | 408,200 | 8,335,444.00 | 0.52 |
| 52 | 601728 | 中国电信 | 1,327,200 | 8,334,816.00 | 0.52 |
| 53 | 000708 | 中信特钢 | 509,300 | 8,082,591.00 | 0.50 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 54 | 300442 | 润泽科技 | 134,700 | 8,056,407.00 | 0.50 |
| 55 | 688041 | 海光信息 | 33,158 | 8,013,625.44 | 0.50 |
| 56 | 000568 | 泸州老窖 | 68,314 | 7,964,729.26 | 0.50 |
| 57 | 300347 | 泰格医药 | 130,800 | 7,927,788.00 | 0.49 |
| 58 | 601211 | 国泰海通 | 370,064 | 7,889,764.48 | 0.49 |
| 59 | 000768 | 中航西飞 | 262,800 | 7,831,440.00 | 0.49 |
| 60 | 688012 | 中微公司 | 22,624 | 7,825,189.12 | 0.49 |
| 61 | 600660 | 福耀玻璃 | 123,700 | 7,811,655.00 | 0.49 |
| 62 | 000157 | 中联重科 | 890,000 | 7,591,700.00 | 0.47 |
| 63 | 002916 | 深南电路 | 31,600 | 7,489,200.00 | 0.47 |
| 64 | 002074 | 国轩高科 | 183,900 | 7,479,213.00 | 0.47 |
| 65 | 601881 | 中国银河 | 463,400 | 7,432,936.00 | 0.46 |
| 66 | 300033 | 同花顺 | 21,400 | 7,432,648.00 | 0.46 |
| 67 | 002028 | 思源电气 | 48,300 | 7,384,587.00 | 0.46 |
| 68 | 000792 | 盐湖股份 | 234,500 | 7,379,715.00 | 0.46 |
| 69 | 300433 | 蓝思科技 | 216,100 | 7,325,790.00 | 0.46 |
| 70 | 000999 | 华润三九 | 251,120 | 7,287,502.40 | 0.45 |
| 71 | 600795 | 国电电力 | 1,445,800 | 7,185,626.00 | 0.45 |
| 72 | 000895 | 双汇发展 | 271,200 | 7,018,656.00 | 0.44 |
| 73 | 601600 | 中国铝业 | 513,900 | 7,014,735.00 | 0.44 |
| 74 | 600066 | 宇通客车 | 213,800 | 6,946,362.00 | 0.43 |
| 75 | 601668 | 中国建筑 | 1,326,300 | 6,883,497.00 | 0.43 |
| 76 | 002371 | 北方华创 | 13,550 | 6,865,378.50 | 0.43 |
| 77 | 300628 | 亿联网络 | 188,000 | 6,754,840.00 | 0.42 |
| 78 | 000963 | 华东医药 | 169,681 | 6,626,043.05 | 0.41 |
| 79 | 601901 | 方正证券 | 835,300 | 6,590,517.00 | 0.41 |
| 80 | 000858 | 五 粮 液 | 60,100 | 6,424,690.00 | 0.40 |
| 81 | 000100 | TCL 科技 | 1,351,700 | 6,271,888.00 | 0.39 |
| 82 | 002736 | 国信证券 | 446,000 | 5,963,020.00 | 0.37 |
| 83 | 600938 | 中国海油 | 209,900 | 5,959,061.00 | 0.37 |
| 84 | 600415 | 小商品城 | 367,406 | 5,948,303.14 | 0.37 |
| 85 | 601319 | 中国人保 | 596,500 | 5,845,700.00 | 0.36 |
| 86 | 603986 | 兆易创新 | 22,300 | 5,770,125.00 | 0.36 |
| 87 | 600050 | 中国联通 | 1,088,400 | 5,714,100.00 | 0.36 |
| 88 | 600039 | 四川路桥 | 548,900 | 5,653,670.00 | 0.35 |
| 89 | 603296 | 华勤技术 | 59,421 | 5,650,937.10 | 0.35 |
| 90 | 600027 | 华电国际 | 1,116,000 | 5,602,320.00 | 0.35 |
| 91 | 688111 | 金山办公 | 16,864 | 5,489,232.00 | 0.34 |
| 92 | 688082 | 盛美上海 | 27,910 | 5,428,215.90 | 0.34 |
| 93 | 601088 | 中国神华 | 128,000 | 5,305,600.00 | 0.33 |
| 94 | 603893 | 瑞芯微 | 28,000 | 5,288,360.00 | 0.33 |
| 95 | 601808 | 中海油服 | 358,600 | 5,127,980.00 | 0.32 |
| 96 | 601100 | 恒立液压 | 44,870 | 5,066,271.70 | 0.32 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 97 | 688008 | 澜起科技 | 37,110 | 4,901,488.80 | 0.31 |
| 98 | 600803 | 新奥股份 | 240,900 | 4,849,317.00 | 0.30 |
| 99 | 600406 | 国电南瑞 | 202,600 | 4,783,386.00 | 0.30 |
| 100 | 601628 | 中国人寿 | 96,500 | 4,728,500.00 | 0.29 |
| 101 | 600176 | 中国巨石 | 269,300 | 4,726,215.00 | 0.29 |
| 102 | 002352 | 顺丰控股 | 120,300 | 4,679,670.00 | 0.29 |
| 103 | 000166 | 申万宏源 | 869,100 | 4,623,612.00 | 0.29 |
| 104 | 000776 | 广发证券 | 207,700 | 4,623,402.00 | 0.29 |
| 105 | 000977 | 浪潮信息 | 65,200 | 4,376,224.00 | 0.27 |
| 106 | 001979 | 招商蛇口 | 477,600 | 4,336,608.00 | 0.27 |
| 107 | 600031 | 三一重工 | 195,400 | 4,187,422.00 | 0.26 |
| 108 | 000063 | 中兴通讯 | 103,900 | 4,154,961.00 | 0.26 |
| 109 | 000408 | 藏格矿业 | 47,000 | 4,136,000.00 | 0.26 |
| 110 | 601877 | 正泰电器 | 138,000 | 4,088,940.00 | 0.25 |
| 111 | 601012 | 隆基绿能 | 217,208 | 4,076,994.16 | 0.25 |
| 112 | 600584 | 长电科技 | 104,200 | 4,061,716.00 | 0.25 |
| 113 | 300498 | 温氏股份 | 239,300 | 4,058,528.00 | 0.25 |
| 114 | 603799 | 华友钴业 | 53,000 | 4,007,860.00 | 0.25 |
| 115 | 000725 | 京东方 A | 911,200 | 3,963,720.00 | 0.25 |
| 116 | 000538 | 云南白药 | 68,300 | 3,907,443.00 | 0.24 |
| 117 | 000938 | 紫光股份 | 150,060 | 3,855,041.40 | 0.24 |
| 118 | 600377 | 宁沪高速 | 328,000 | 3,837,600.00 | 0.24 |
| 119 | 601818 | 光大银行 | 1,076,300 | 3,734,761.00 | 0.23 |
| 120 | 601658 | 邮储银行 | 684,300 | 3,702,063.00 | 0.23 |
| 121 | 601688 | 华泰证券 | 150,600 | 3,606,870.00 | 0.22 |
| 122 | 601009 | 南京银行 | 308,000 | 3,372,600.00 | 0.21 |
| 123 | 600011 | 华能国际 | 445,300 | 3,290,767.00 | 0.21 |
| 124 | 601888 | 中国中免 | 35,000 | 3,253,250.00 | 0.20 |
| 125 | 600926 | 杭州银行 | 206,300 | 3,249,225.00 | 0.20 |
| 126 | 000786 | 北新建材 | 122,800 | 3,175,608.00 | 0.20 |
| 127 | 002920 | 德赛西威 | 23,800 | 3,160,878.00 | 0.20 |
| 128 | 600000 | 浦发银行 | 271,500 | 3,133,110.00 | 0.20 |
| 129 | 300759 | 康龙化成 | 99,500 | 3,102,410.00 | 0.19 |
| 130 | 300124 | 汇川技术 | 39,696 | 3,079,615.68 | 0.19 |
| 131 | 600489 | 中金黄金 | 126,200 | 3,060,350.00 | 0.19 |
| 132 | 600760 | 中航沈飞 | 49,460 | 3,057,122.60 | 0.19 |
| 133 | 601766 | 中国中车 | 428,000 | 3,004,560.00 | 0.19 |
| 134 | 688036 | 传音控股 | 43,959 | 2,945,692.59 | 0.18 |
| 135 | 601298 | 青岛港 | 350,500 | 2,923,170.00 | 0.18 |
| 136 | 300866 | 安克创新 | 26,300 | 2,825,409.00 | 0.18 |
| 137 | 300760 | 迈瑞医疗 | 14,000 | 2,823,940.00 | 0.18 |
| 138 | 000807 | 云铝股份 | 84,015 | 2,784,257.10 | 0.17 |
| 139 | 600482 | 中国动力 | 117,860 | 2,779,138.80 | 0.17 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 140 | 600028 | 中国石化 | 457,200 | 2,775,204.00 | 0.17 |
| 141 | 600061 | 国投资本 | 358,000 | 2,774,500.00 | 0.17 |
| 142 | 300014 | 亿纬锂能 | 39,900 | 2,753,100.00 | 0.17 |
| 143 | 688187 | 时代电气 | 51,314 | 2,655,499.50 | 0.17 |
| 144 | 300476 | 胜宏科技 | 8,700 | 2,572,590.00 | 0.16 |
| 145 | 002938 | 鹏鼎控股 | 47,900 | 2,531,515.00 | 0.16 |
| 146 | 601838 | 成都银行 | 153,300 | 2,488,059.00 | 0.16 |
| 147 | 002241 | 歌尔股份 | 84,800 | 2,482,944.00 | 0.15 |
| 148 | 600522 | 中天科技 | 132,200 | 2,408,684.00 | 0.15 |
| 149 | 603019 | 中科曙光 | 25,700 | 2,390,100.00 | 0.15 |
| 150 | 600809 | 山西汾酒 | 13,300 | 2,347,450.00 | 0.15 |
| 151 | 301236 | 软通动力 | 47,900 | 2,346,621.00 | 0.15 |
| 152 | 600600 | 青岛啤酒 | 37,600 | 2,327,440.00 | 0.15 |
| 153 | 000975 | 山金国际 | 93,312 | 2,304,806.40 | 0.14 |
| 154 | 600570 | 恒生电子 | 74,629 | 2,304,543.52 | 0.14 |
| 155 | 605117 | 德业股份 | 25,620 | 2,273,262.60 | 0.14 |
| 156 | 002179 | 中航光电 | 58,309 | 2,244,896.50 | 0.14 |
| 157 | 600233 | 圆通速递 | 131,600 | 2,170,084.00 | 0.14 |
| 158 | 601186 | 中国铁建 | 268,200 | 2,091,960.00 | 0.13 |
| 159 | 600018 | 上港集团 | 377,600 | 2,061,696.00 | 0.13 |
| 160 | 600188 | 兖矿能源 | 144,600 | 2,060,550.00 | 0.13 |
| 161 | 601058 | 赛轮轮胎 | 125,329 | 2,042,862.70 | 0.13 |
| 162 | 600674 | 川投能源 | 143,353 | 2,012,676.12 | 0.13 |
| 163 | 000425 | 徐工机械 | 167,700 | 1,908,426.00 | 0.12 |
| 164 | 601988 | 中国银行 | 331,800 | 1,831,536.00 | 0.11 |
| 165 | 601607 | 上海医药 | 101,600 | 1,812,544.00 | 0.11 |
| 166 | 600362 | 江西铜业 | 32,900 | 1,810,487.00 | 0.11 |
| 167 | 600875 | 东方电气 | 69,800 | 1,776,410.00 | 0.11 |
| 168 | 600023 | 浙能电力 | 349,900 | 1,759,997.00 | 0.11 |
| 169 | 600089 | 特变电工 | 72,950 | 1,754,447.50 | 0.11 |
| 170 | 600104 | 上汽集团 | 104,700 | 1,609,239.00 | 0.10 |
| 171 | 600048 | 保利发展 | 231,000 | 1,522,290.00 | 0.09 |
| 172 | 000596 | 古井贡酒 | 11,032 | 1,500,241.68 | 0.09 |
| 173 | 601816 | 京沪高铁 | 291,000 | 1,484,100.00 | 0.09 |
| 174 | 002714 | 牧原股份 | 29,000 | 1,454,640.00 | 0.09 |
| 175 | 300999 | 金龙鱼 | 48,400 | 1,426,832.00 | 0.09 |
| 176 | 600585 | 海螺水泥 | 61,100 | 1,399,801.00 | 0.09 |
| 177 | 600016 | 民生银行 | 341,300 | 1,307,179.00 | 0.08 |
| 178 | 603288 | 海天味业 | 34,200 | 1,300,284.00 | 0.08 |
| 179 | 600346 | 恒力石化 | 53,300 | 1,268,007.00 | 0.08 |
| 180 | 688303 | 大全能源 | 41,416 | 1,173,729.44 | 0.07 |
| 181 | 600015 | 华夏银行 | 172,400 | 1,170,596.00 | 0.07 |
| 182 | 601898 | 中煤能源 | 82,900 | 1,134,901.00 | 0.07 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 183 | 600160 | 巨化股份 | 29,300 | 1,111,642.00 | 0.07 |
| 184 | 601229 | 上海银行 | 102,100 | 1,015,895.00 | 0.06 |
| 185 | 601878 | 浙商证券 | 76,800 | 845,568.00 | 0.05 |
| 186 | 601077 | 渝农商行 | 128,100 | 832,650.00 | 0.05 |
| 187 | 601998 | 中信银行 | 110,700 | 820,287.00 | 0.05 |
| 188 | 300316 | 晶盛机电 | 21,100 | 819,946.00 | 0.05 |
| 189 | 601633 | 长城汽车 | 31,500 | 696,150.00 | 0.04 |
| 190 | 600029 | 南方航空 | 86,400 | 692,064.00 | 0.04 |
| 191 | 600111 | 北方稀土 | 13,400 | 652,714.00 | 0.04 |
| 192 | 600930 | 华电新能 | 99,713 | 631,183.29 | 0.04 |
| 193 | 300408 | 三环集团 | 13,300 | 624,967.00 | 0.04 |
| 194 | 302132 | 中航成飞 | 7,500 | 621,675.00 | 0.04 |
| 195 | 002625 | 光启技术 | 10,900 | 549,033.00 | 0.03 |
| 196 | 600547 | 山东黄金 | 13,100 | 542,078.00 | 0.03 |
| 197 | 300896 | 爱美客 | 3,620 | 528,483.80 | 0.03 |
| 198 | 002384 | 东山精密 | 6,200 | 502,882.00 | 0.03 |
| 199 | 601985 | 中国核电 | 54,500 | 495,405.00 | 0.03 |
| 200 | 600438 | 通威股份 | 19,691 | 426,507.06 | 0.03 |
| 201 | 600025 | 华能水电 | 12,900 | 117,648.00 | 0.01 |

## 7.3.2 期末积极投资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 | 600096 | 云天化 | 83,400 | 2,893,980.00 | 0.18 |
| 2 | 000960 | 锡业股份 | 87,900 | 2,757,423.00 | 0.17 |
| 3 | 688795 | 摩尔线程 | 5,660 | 2,699,480.40 | 0.17 |
| 4 | 002821 | 凯莱英 | 20,000 | 2,007,200.00 | 0.13 |
| 5 | 600582 | 天地科技 | 323,000 | 1,905,700.00 | 0.12 |
| 6 | 600511 | 国药股份 | 62,900 | 1,829,132.00 | 0.11 |
| 7 | 002555 | 三七互娱 | 67,200 | 1,801,632.00 | 0.11 |
| 8 | 688802 | 沐曦股份 | 3,994 | 1,765,867.22 | 0.11 |
| 9 | 688759 | 必贝特 | 12,552 | 531,702.72 | 0.03 |
| 10 | 002078 | 太阳纸业 | 30,200 | 480,784.00 | 0.03 |
| 11 | 688790 | 昂瑞微 | 2,319 | 304,902.12 | 0.02 |
| 12 | 301656 | 联合动力 | 7,025 | 185,951.75 | 0.01 |
| 13 | 001280 | 中国铀业 | 2,277 | 107,861.49 | 0.01 |
| 14 | 688809 | 强一股份 | 259 | 66,019.10 | 0.00 |
| 15 | 301638 | 南网数字 | 2,322 | 35,573.04 | 0.00 |
| 16 | 001386 | 马可波罗 | 1,626 | 30,975.30 | 0.00 |
| 17 | 603352 | 至信股份 | 1,115 | 24,396.20 | 0.00 |
| 18 | 001233 | 海安集团 | 370 | 20,801.40 | 0.00 |
| 19 | 688796 | 百奥赛图 | 423 | 19,039.23 | 0.00 |
| 20 | 688807 | 优迅股份 | 131 | 18,539.12 | 0.00 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 21 | 301563 | 云汉芯城 | 110 | 18,064.20 | 0.00 |
| 22 | 301632 | 广东建科 | 656 | 16,026.08 | 0.00 |
| 23 | 301491 | 汉桑科技 | 245 | 14,136.50 | 0.00 |
| 24 | 301584 | 建发致新 | 447 | 12,685.86 | 0.00 |
| 25 | 301609 | 山大电力 | 277 | 11,924.85 | 0.00 |
| 26 | 001369 | 双欣材料 | 897 | 10,611.51 | 0.00 |
| 27 | 301687 | 新广益 | 195 | 10,085.40 | 0.00 |
| 28 | 688805 | 健信超导 | 265 | 9,373.05 | 0.00 |
| 29 | 001221 | 悍高集团 | 160 | 9,342.40 | 0.00 |
| 30 | 603175 | 超颖电子 | 169 | 8,941.79 | 0.00 |
| 31 | 603092 | 德力佳 | 146 | 8,704.52 | 0.00 |
| 32 | 301667 | 纳百川 | 151 | 8,378.99 | 0.00 |
| 33 | 001285 | 瑞立科密 | 137 | 8,021.35 | 0.00 |
| 34 | 603418 | 友升股份 | 139 | 7,991.11 | 0.00 |
| 35 | 301668 | 昊创瑞通 | 165 | 7,977.75 | 0.00 |
| 36 | 301449 | 天溯计量 | 112 | 7,342.72 | 0.00 |
| 37 | 601026 | 道生天合 | 451 | 6,607.15 | 0.00 |
| 38 | 301575 | 艾芬达 | 126 | 6,215.58 | 0.00 |
| 39 | 603406 | 天富龙 | 153 | 6,054.21 | 0.00 |
| 40 | 603262 | 技源集团 | 155 | 4,462.45 | 0.00 |
| 41 | 603248 | 锡华科技 | 260 | 4,383.60 | 0.00 |
| 42 | 603370 | 华新精科 | 82 | 3,876.14 | 0.00 |
| 43 | 603334 | 丰倍生物 | 88 | 3,075.60 | 0.00 |
| 44 | 603376 | 大明电子 | 111 | 2,992.56 | 0.00 |
| 45 | 001396 | 誉帆科技 | 69 | 2,281.83 | 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 | 300750 | 宁德时代 | 5,535,205.00 | 0.39 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 4,481,872.00 | 0.31 |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 4,145,352.00 | 0.29 |
| 4 | 601899 | 紫金矿业 | 3,475,662.00 | 0.24 |
| 5 | 600036 | 招商银行 | 3,076,355.00 | 0.22 |
| 6 | 300308 | 中际旭创 | 2,669,204.00 | 0.19 |
| 7 | 601166 | 兴业银行 | 2,494,322.00 | 0.17 |
| 8 | 300502 | 新易盛 | 2,085,847.00 | 0.15 |
| 9 | 002475 | 立讯精密 | 2,049,049.00 | 0.14 |
| 10 | 000333 | 美的集团 | 1,970,189.00 | 0.14 |
| 11 | 600030 | 中信证券 | 1,828,362.00 | 0.13 |
| 12 | 603259 | 药明康德 | 1,749,242.00 | 0.12 |
| 13 | 601138 | 工业富联 | 1,679,673.00 | 0.12 |
| 14 | 300274 | 阳光电源 | 1,581,110.00 | 0.11 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 15 | 688256 | 寒武纪 | 1,528,904.02 | 0.11 |
| 16 | 600887 | 伊利股份 | 1,517,645.00 | 0.11 |
| 17 | 601328 | 交通银行 | 1,382,084.00 | 0.10 |
| 18 | 600150 | 中国船舶 | 1,341,737.92 | 0.09 |
| 19 | 600919 | 江苏银行 | 1,255,423.00 | 0.09 |
| 20 | 601398 | 工商银行 | 1,254,707.00 | 0.09 |

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 | 001388 | 信通电子 | 4,046.70 | 0.00 |

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 | 128,689,443.18 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 4,046.70 |

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 | 88,098,154.03 | 5.49 |
| 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 | 88,098,154.03 | 5.49 |

## 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 | 019773 | 25 国债 08 | 280,000 | 28,291,107.94 | 1.76 |
| 2 | 019766 | 25 国债 01 | 254,000 | 25,689,796.60 | 1.60 |
| 3 | 102291 | 国债 2501 | 99,000 | 10,012,952.22 | 0.62 |
| 4 | 019792 | 25 国债 19 | 80,000 | 8,030,012.05 | 0.50 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 5 | 019785 | 25 国债 13 | 60,000 | 6,039,129.86 | 0.38 |

## 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

本基金主要利用股指期货提高投资效率，以更好地实现本基金的投资目标，降低跟踪误差。此外，在预期大额申购赎回、大额分红等情形发生时，本基金可以通过股指期货进行有效的现金头寸管理。

本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，并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 投资组合报告附注

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

基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚，无证券投资决策程序需特别说明。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 14,377,482.88 |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 402,137.26 |
| 6 | 其他应收款 | - |

| | | |
|---|---|---|
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 14,779,620.14 |

### 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

### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 688795 | 摩尔线程 | 2,699,480.40 | 0.17 | 新股锁定 |

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，合计数可能不等于分项之和。

## §8 基金份额持有人信息（转型后）

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别 | 持有人户数（户） | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | | 持有份额 | 占总份额比例（%） | 持有份额 | 占总份额比例（%） |
| 华宝沪深 300 增强策略 ETF 发起式联接 A | 55,200 | 4,874.86 | 84,651,806.88 | 31.46 | 184,440,478.77 | 68.54 |
| 华宝沪深 300 增强策略 ETF 发起式联接 C | 4,971 | 3,415.92 | 288,875.10 | 1.70 | 16,691,676.03 | 98.30 |
| 合计 | 60,171 | 4,754.33 | 84,940,681.98 | 29.69 | 201,132,154.80 | 70.31 |

## 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 | 华宝沪深 300 增强策略 ETF 发起式联接 A | 248,982.89 | 0.0925 |
| | 华宝沪深 300 增强策略 ETF 发起式联接 C | 288,358.11 | 1.6982 |
| | 合计 | 537,341.00 | 0.1878 |

## 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） |
|---|---|---|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 华宝沪深 300 增强策略 ETF 发起式联接 A | 0 |
| | 华宝沪深 300 增强策略 ETF 发起式联接 C | 10~50 |
| | 合计 | 10~50 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 华宝沪深 300 增强策略 ETF 发起式联接 A | 10~50 |
| | 华宝沪深 300 增强策略 ETF 发起式联接 C | 10~50 |
| | 合计 | 10~50 |

## 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

# §8 基金份额持有人信息（转型前）

## 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别 | 持有人户数（户） | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | | 持有份额 | 占总份额比例（%） | 持有份额 | 占总份额比例（%） |
| 华宝沪深 300 增强 A | 61,713 | 15,787.61 | 766,458,469.04 | 78.67 | 207,842,095.84 | 21.33 |
| 华宝沪深 300 增强 C | 5,571 | 26,663.93 | 128,677,442.10 | 86.63 | 19,867,302.06 | 13.37 |
| 合计 | 67,284 | 16,688.15 | 895,135,911.14 | 79.72 | 227,709,397.90 | 20.28 |

## 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 | 华宝沪深 300 增强 A | 491,361.32 | 0.0504 |
| | 华宝沪深 300 增强 C | 288,358.11 | 0.1941 |
| | 合计 | 779,719.43 | 0.0694 |

## 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） |
|---|---|---|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 华宝沪深 300 增强 A | 10~50 |
| | 华宝沪深 300 增强 C | 10~50 |
| | 合计 | 10~50 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 华宝沪深 300 增强 A | 10~50 |
| | 华宝沪深 300 增强 C | 10~50 |
| | 合计 | 50~100 |

## 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

# §9 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

| 项目 | 华宝沪深 300 增强策略 ETF 发起式联接 A | 华宝沪深 300 增强策略 ETF 发起式联接 C |
|---|---|---|
| 基金合同生效日（2026 年 1 月 9 日）基金份额总额 | 974,300,564.88 | 148,544,744.16 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | 24,026,359.83 | 9,238,736.35 |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 729,234,639.06 | 140,802,929.38 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 269,092,285.65 | 16,980,551.13 |

注：本基金合同生效日于 2026 年 01 月 09 日。

# §9 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

| 项目 | 华宝沪深 300 增强 A | 华宝沪深 300 增强 C |
| --- | --- | --- |
| 基金合同生效日（2016 年 12 月 9 日）基金份额总额 | 10,000,450.05 | - |
| 本报告期期初基金份额总额 | 976,221,781.17 | 39,025,091.23 |
| 本报告期基金总申购份额 | 583,462.04 | 110,973,525.33 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 2,504,678.33 | 1,453,872.40 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 974,300,564.88 | 148,544,744.16 |

注：本基金合同生效日于 2016 年 12 月 09 日。

# §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，基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

## 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：自 2025 年 11 月 11 日起至本报告期末。

## 10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

### 10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

### 10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

### 10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

### 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无受调查或处罚的情况。

## 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(转型后)

### 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(%) | |
| 麦高证券 | 2 | 1,658,226,840.23 | 74.75 | 301,641.98 | 74.34 | - |
| 国泰海通 | 8 | 490,494,931.69 | 22.11 | 91,177.93 | 22.47 | - |
| 华鑫证券 | 2 | 69,641,582.83 | 3.14 | 12,947.65 | 3.19 | - |

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

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

2、本报告期租用的证券公司交易单元新增的有：华鑫证券。

### 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 | | 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(%) |
| 麦高证券 | 58,256,836.83 | 52.20 | 881,700,000.00 | 47.73 | - | - | 477,701,099.70 | 99.27 |
| 国泰海通 | 53,354,387.30 | 47.80 | 767,000,000.00 | 41.52 | - | - | 2,528,246.00 | 0.53 |
| 华鑫证券 | - | - | 198,500,000.00 | 10.75 | - | - | 968,600.00 | 0.20 |

### 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(转型前)

### 10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例(%) | 佣金 | 占当期佣金总量的比例(%) | |
| 国泰海通 | 8 | 128,669,093.68 | 100.00 | 23,919.73 | 100.00 | - |
| 麦高证券 | 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:资力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；适当的地域分散化。

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

2、本期交易单元未发生变化。

## 10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例(%) | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例(%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例(%) |
| 国泰海通 | 8,028,812.07 | 100.00 | 299,000,000.00 | 100.00 | - | - |
| 麦高证券 | - | - | - | - | - | - |

## 10.8 其他重大事件（转型后）

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|---|---|---|---|
| 1 | 关于华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金变更为华宝沪深 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并修订基金合同等法律文件的公告 | 基金管理人网站,证券时报 | 2026-01-08 |
| 2 | 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合同 | 基金管理人网站 | 2026-01-08 |
| 3 | 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托管协议 | 基金管理人网站 | 2026-01-08 |
| 4 | 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招募说明书 | 基金管理人网站 | 2026-01-08 |
| 5 | 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（A 类份额）基金产品资料概要（更新） | 基金管理人网站 | 2026-01-08 |
| 6 | 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（C 类份额）基金产品资料概要（更新） | 基金管理人网站 | 2026-01-08 |
| 7 | 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 |
| 8 | 华宝沪深 300 指数增强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 |
| 9 | 华宝沪深 300 指数增强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 |
| 10 | 华宝基金关于旗下部分基金新增上 | 基金管理人网站 | 2026-04-15 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 海证达通基金销售有限公司为代销机构的通知 | | |
| 11 | 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 2026 年第 1 季度报告 | 基金管理人网站 | 2026-04-22 |
| 12 | 华宝基金关于旗下部分基金新增南京银行股份有限公司为代销机构的公告 | 基金管理人网站,上海证券报,证券日报,证券时报,中国证券报 | 2026-04-24 |
| 13 | 华宝基金关于旗下部分基金新增宁波银行股份有限公司为代销机构的公告 | 基金管理人网站,上海证券报,证券日报,证券时报,中国证券报 | 2026-05-22 |
| 14 | 华宝基金关于旗下部分基金新增国元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 | 2026-05-25 |
| 15 | 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 |
| 16 | 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 |

## 10.8 其他重大事件（转型前）

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|---|---|---|---|
| 1 | 关于华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金变更为华宝沪深 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并修订基金合同等法律文件的公告 | 基金管理人网站,证券时报 | 2026-01-08 |
| 2 | 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合同 | 基金管理人网站 | 2026-01-08 |
| 3 | 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（C 类份额）基金产品资料概要（更新） | 基金管理人网站 | 2026-01-08 |
| 4 | 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招募说明书 | 基金管理人网站 | 2026-01-08 |
| 5 | 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（A 类份额）基金产品资料概要（更新） | 基金管理人网站 | 2026-01-08 |
| 6 | 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托管协议 | 基金管理人网站 | 2026-01-08 |

# §11 影响投资者决策的其他重要信息

## 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比（%） |
| 机构 | 1 | 20260130~20260304 | 109,778,854.02 | 0.00 | 109,778,854.02 | 0.00 | 0.00 |
| 个人 | 1 | 20260617~20260630 | 58,089,929.82 | 0.00 | 0.00 | 58,089,929.82 | 20.31 |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 报告期内本基金出现单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况。<br>在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下，如该投资者集中赎回，可能会增加基金的流动性风险。此外，由于基金在遇到大额赎回的时候可能需要变现部分资产，可能对持有资产的价格形成冲击，增加基金的市场风险。基金管理人将专业审慎、勤勉尽责地运作基金资产，加强防范流动性风险、市场风险，保护持有人利益。 | | | | | | | |

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于 2026 年 01 月 08 日发布关于华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金变更为华宝沪深 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并修订基金合同等法律文件的公告，具体内容详见公司公告，请投资者予以关注。

# §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合同；

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招募说明书；

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托管协议；

基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；

基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；

基金托管人业务资格批件和营业执照。

## 12.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

## 12.3 查阅方式

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

**华宝基金管理有限公司**

**2026 年 8 月 31 日**