

华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资
基金
2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2026 年 3 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。本年度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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 03 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。

本报告中的财务资料已经审计，容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 2025 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§ 7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	22
§ 8 投资组合报告	52
8.1 期末基金资产组合情况	52
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	52

8.3 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	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	67
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	68
8.6 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	68
8.7 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	68
8.8 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	68
8.9 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	68
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	68
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	68
8.12 投资组合报告附注	69
§ 9 基金份额持有人信息	70
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	70
9.2 期末上市基金前十名持有人	70
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	71
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	71
§ 10 开放式基金份额变动	71
§ 11 重大事件揭示	72
11.1 基金份额持有人大会决议	72
11.2 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	72
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	72
11.4 基金投资策略的改变	72
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	72
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	72
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	73
11.8 其他重大事件	73
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	75
12.1 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	75
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	76
§ 13 备查文件目录	76
13.1 备查文件目录	76
13.2 存放地点	76
13.3 查阅方式	76

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华宝中证 A500ETF
场内简称	A500ETF 华宝
基金主代码	563500
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 11 月 22 日
基金管理人	华宝基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	993,958,712.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2024 年 12 月 2 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。 对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将通过投资成份股、非成份股、成份股个股衍生品等进行替代。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用组合复制策略，跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

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	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周雷	冯萌
	联系电话	021-38505888	021-52629999-213310
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	fengmeng@cib.com.cn
客户服务电话		400-700-5588、400-820-5050	95561
传真		021-38505777	021-62159217
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦

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	上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼
邮政编码	200120	200120
法定代表人	夏雪松	吕家进

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人办公场所和基金托管人办公场所。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2025 年	2024 年 11 月 22 日（基金合同生效日） - 2024 年 12 月 31 日
本期已实现收益	165,418,136.22	16,150,582.08
本期利润	253,746,079.92	21,330,943.48
加权平均基金份额本期利润	0.1877	0.0105
本期加权平均净值利润率	19.78%	1.03%
本期基金份额净值增长率	25.96%	1.17%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末	2024 年末
期末可供分配利润	88,983,540.69	15,821,990.69
期末可供分配基金份额利润	0.0895	0.0080
期末基金资产净值	617,304,352.84	1,995,990,748.49
期末基金份额净值	0.6211	1.0117

3.1.3 累计期末指标	2025 年末	2024 年末
基金份额累计净值增长率	27.43%	1.17%

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

2. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3. 净值相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

4. 期末可供分配利润采用资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

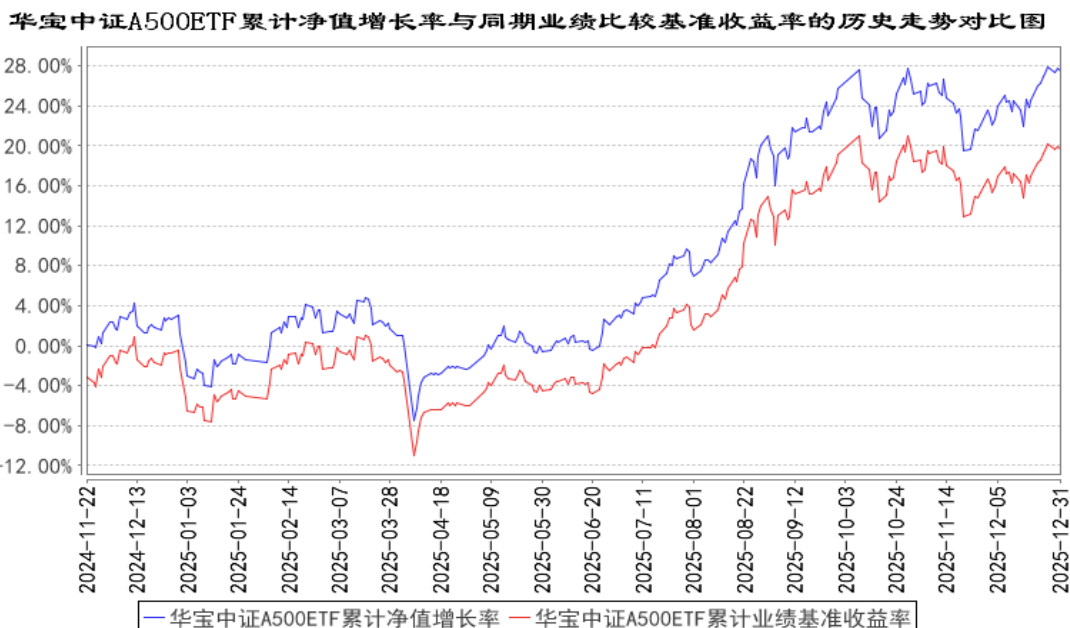
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.41%	1.05%	0.43%	1.05%	0.98%	0.00%
过去六个月	23.89%	0.99%	21.86%	1.00%	2.03%	-0.01%
过去一年	25.96%	1.04%	22.43%	1.05%	3.53%	-0.01%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	27.43%	1.02%	19.63%	1.05%	7.80%	-0.03%

注：（1）基金业绩基准：中证 A500 指数收益率；

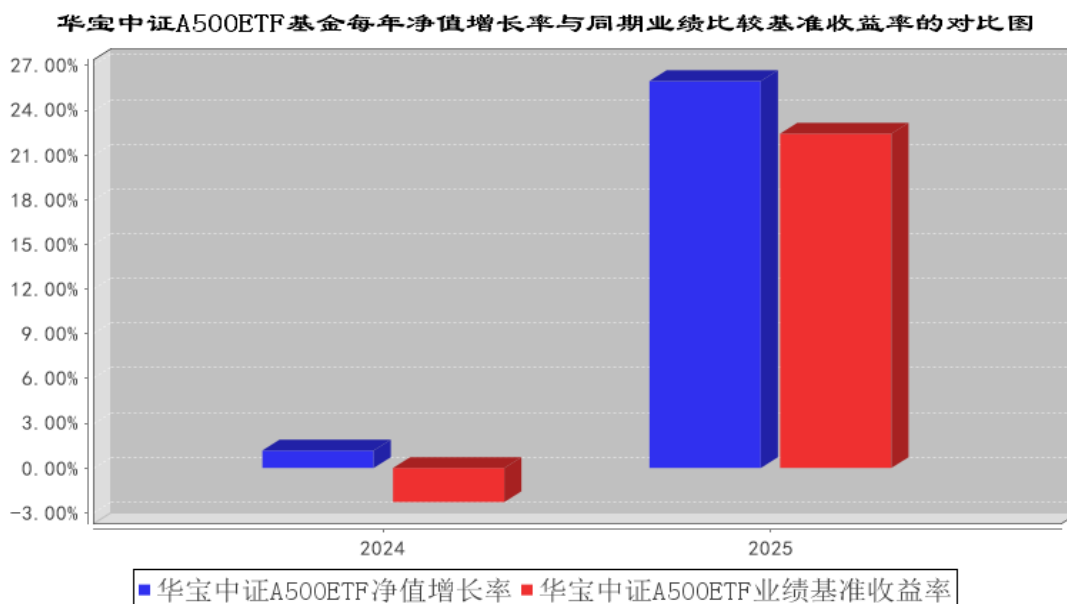
（2）净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

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



注：按照基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定，截至 2025 年 05 月 22 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金成立未满五年，基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分	现金形式发放总额	再投资形式发放总	年度利润分配合计	备注
----	-------------	----------	----------	----------	----

	红数		额		
2025 年	0.2260	24,325,104.70	-	24,325,104.70	-
合计	0.2260	24,325,104.70	-	24,325,104.70	-

§ 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（2025 年 12 月 31 日），本公司正在管理运作的公开募集证券投资基金共 163 只，涵盖股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金、FOF 等。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
蒋俊阳	本基金基金经理、指数研发投资部副总经理	2024-11-22	-	17 年	硕士。曾在上海申银万国证券研究所、光大证券研究所从事研究工作。2018 年 10 月加入华宝基金管理有限公司担任基金经理助理。2020 年 7 月起任华宝中证电子 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2020 年 12 月起任华宝中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 3 月至 2022 年 2 月任华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 6 月至 2025 年 9 月任华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 7 月起任华宝中证细分食品饮料产业主题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，2021 年 7 月起任华宝中证电子 50 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，2021 年 9 月至 2024 年 9 月任华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基

				<p>金经理，2021 年 11 月起任华宝中证 800 地产交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2024 年 3 月起任华宝中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2024 年 4 月起任华宝中证 A50 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，2024 年 11 月起任华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 1 月起任华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2025 年 4 月起任华宝深证 100 指数型发起式证券投资基金基金经理，2025 年 9 月起任华宝深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 9 月至 2025 年 11 月任华宝港股通恒生中国(香港上市)30 指数证券投资基金(LOF)基金经理，2025 年 9 月起任华宝港股通恒生中国(香港上市)30 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 11 月起任华宝港股通恒生中国(香港上市)30 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金经理，2025 年 12 月起任华宝北证 50 成份指数型证券投资基金基金经理，2026 年 2 月起任华宝中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金、华宝中证科创创业 50 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。</p>
--	--	--	--	--

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期内，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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、《华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

基金管理人从研究分析、授权、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动的各个环节出发制定了公司内部的公平交易制度以确保公司所有投资组合在各个环节得到公平的对待。公平交易制度和控制方法适用公司管理所有投资组合（包括公募基金、特定客户资产管理组合），对应的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动。

研究分析方面，公司使用统一的投资研究管理系统，并规定所有与投资业务相关的研究报告和股票入库信息必须在该系统中发表和存档。同时，该系统对所有投资组合经理设置相同的使用权限。

授权和投资决策方面，投资组合经理在其权限范围内的投资决策保持独立，并对其投资决策的结果负责。通过各个系统的权限设置使投资组合经理仅能看到自己的组合情况。

交易执行方面，所有投资组合的投资指令必须通过交易系统分发和执行。对于交易所公开竞价交易，交易系统内置公平交易执行程序。公司内部制度规定此类交易指令需执行公平交易程序，由交易部负责人负责执行。针对其他不能通过系统执行公平交易程序且必须以公司名义统一进行交易的指令，公司内部制定相关制度流程以确保此类交易的公允分配。同时，公司根据法规要求在交易系统中设置一系列投资禁止与限制指标对公平交易的执行进行事前控制，主要包括限制公司旗下组合自身及组合间反向交易、对敲交易、银行间关联方交易等。

事后监督，公司的风险管理部作为独立第三方对所有投资行为进行事后监督，主要监督的事项包括以下内容。

1) 每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析。

2) 每季度和每年度对公司管理的不同投资组合所有交易所二级市场交易进行1日、3日、5日同向交易价差分析。

3) 对公司管理的不同投资组合的所有银行间债券买卖和回购交易进行分析。监督的内容包括以下几点，同一投资组合短期内对同一债券的反向交易，债券买卖到期收益率与中债登估价收益率之间的差异，回购利率与当日市场平均利率之间的差异。对上述监督内容存在异常的情况要求投资组合经理进行合理性解释。

4) 对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程的公允性进行监督。

4.3.2 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。

4.3.3 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 1 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

2025 年，我国经济运行稳中有进，经济结构深度调整，高质量发展扎实推进。产业政策导向明确，新质生产力相关领域成为中长期投资主线，技术突破与国产替代加速落地。全球流动性周期转向宽松预期增强，外资回流与国内长线资金入市成为 A 股重要支撑力量，估值修复动能逐步释放。2025 年 A 股市场整体呈现震荡上行的“慢牛”格局，科技与资源成为主要驱动因素，有色、通信、电子、电气设备、国防军工等行业表现较好，食品饮料、煤炭等行业表现相对较弱。指数方面，以中证 100 和沪深 300 为代表的大盘蓝筹股指数全年分别上涨了 20.44% 和 17.66%；而以成长股为代表的中证 1000 和创业板指全年分别上涨了 27.49% 和 49.57%。本报告期内，中证 A500 指数累计上涨了 22.43%。

本报告期本基金为正常运作期，我们在操作中严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为 25.96%，业绩比较基准收益率为 22.43%。

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，央行将继续实施适度宽松的货币政策，灵活高效运用降准降息等多种货币政

策工具，保持流动性充裕，把促进经济稳定增长、物价合理回升作为货币政策的重要考量。2026 年为“十五五”开局之年，“十五五”规划通过科技创新、内需提振与安全能力建设的三维驱动，为中国式现代化提供系统性支撑，同时将深化供给侧结构性改革，优化产业布局，并对资本市场带来结构性机遇。

近年来，核心资产作为中国优质公司的代表，凭借在经济复苏中的扎实业绩、较有吸引力的估值水平，赢得了投资者的广泛关注。中证 A500 指数作为 A 股核心资产的重要代表之一，从各行业选取市值较大、流动性较好的 500 只证券作为指数样本，以反映各行业最具代表性上市公司证券的整体表现。

作为指数基金的管理人，我们将继续严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，积极应对成分股调整和基金申购赎回，严格控制基金相对目标指数的跟踪误差，实现中证 A500 指数的有效跟踪。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

公司作为公募基金管理人，自 2003 年 3 月成立以来始终注重合规性和业务风险控制，加强对基金运作的内部操作风险控制、保障基金份额持有人的利益始终是公司制定各项内部制度和流程的指导思想。

（一）管理人的监察稽核工作以有效防控经营及持牌业务合规风险为目的，在制定规章制度、重大事项决策、重要合同签订、重大项目等经营管理环节中，设置合规风险评估审查机制，由法务合规部门或合规负责人对法律风险、合规风险进行甄别，提示合规风险及改进建议。合规审计部门对业务经营各环节的关键操作、法律文件、产品方案、产品立项等进行事前合规审查、事中法务支持、事后监督检查，出具合规咨询反馈、合规审查意见、合规检查建议等，并定期向管理层汇报行业监管动态、合规提示/警示/案例、重要合规检查和审计发现及其整改情况等。合规审计部门在报告期内，根据重要法律法规、监管通报、行业风险事件牵头各部门进行合规检查，解读监管要求、指定责任部门、分解落实任务，做到先知先行、查漏补缺。

（二）规范员工行为操守，加强职业道德教育和合规风险教育。公司通过对新员工集中组织岗前培训、签署《员工保密承诺书》《从业资格承诺书》、分发《员工合规手册》等形式，每年安排员工签署《从业人员年度合规承诺函》，明确员工的行为准则和合规管理目标，防范道德风险，承诺履行合规义务。并在具体工作中坚持加强法规培训，努力培养员工的风险意识、合法合规意识。

（三）有重点地全面开展内部审计稽核工作。本年度，合规审计部门依据监管规定与年度审计计划对公司投研、市场、运营部门进行了专项审计与定期稽核，对投资组合经理开展离任审查，

发现问题并提出审计建议，并与相关责任部门进行沟通，定期进行整改跟踪的闭环管理，不断提高工作质量。

在今后的工作中，管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，完善内控制度，提高工作水平，努力防范和控制各种风险，全力保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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其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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据法律法规及基金合同的规定，本基金于 2025 年 5 月 15 日发布了分红公告，本次分红为 2025 年度的第 1 次分红。本基金向 2025 年 5 月 19 日在本基金注册登记机构登记在册的基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.037 元，利润分配合计为人民币 5,413,023.77 元，其中现金形式发放总额为人民币 5,413,023.77 元，再投资形式发放总额为人民币 0 元。本基金于 2025 年 8 月 12 日发布了分红公告，本次分红为 2025 年度的第 2 次分红。本基金向 2025 年 8 月 14 日在本基金注册登记机构登记在册的基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.126 元，利润分配合计为人民币 11,175,940.55 元，其中现金形式发放总额为人民币 11,175,940.55 元，再投资形式发放总额为人民币 0 元。本基金于 2025 年 11 月 12 日发布了分红公告，本次分红为 2025 年度的第 3 次分红。本基金向 2025 年 11 月 14 日在本基金注册登记机构登记在册的基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.063 元，利润分配合计为人民币 7,736,140.38 元，其中现金形

式发放总额为人民币 7,736,140.38 元，再投资形式发放总额为人民币 0 元。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本年度/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，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	容诚审字[2026]200Z2276 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“华宝中证 A500ETF”）财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日和 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度

	<p>和 2024 年 11 月 22 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了华宝中证 A500ETF2025 年 12 月 31 日和 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度和 2024 年 11 月 22 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则和中国注册会计师独立性准则，我们独立于华宝中证 A500ETF，并遵守了独立性准则中适用于公众利益实体财务报表审计的规定，同时履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>华宝中证 A500ETF 的基金管理人华宝基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估华宝中证 A500ETF 的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算华宝中证 A500ETF、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督华宝中证 A500ETF 的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、</p>

	<p>适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对导致对华宝中证 A500ETF 持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华宝中证 A500ETF 不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	陈迺迤 林佳璐
会计师事务所的地址	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26
审计报告日期	2026 年 3 月 25 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	1,388,678.92	10,824,984.05
结算备付金		4,454,028.76	33,060,899.19
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	611,759,436.71	1,958,370,126.85
其中：股票投资		611,759,436.71	1,958,370,126.85
基金投资		-	-

债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		617,602,144.39	2,002,256,010.09
负债和净资产	附注号	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		13,499.02	43,319.67
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		83,850.24	264,368.03
应付托管费		27,950.09	88,122.68
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	172,492.20	5,869,451.22
负债合计		297,791.55	6,265,261.60
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	496,979,355.99	1,972,979,356.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	120,324,996.85	23,011,392.49
净资产合计		617,304,352.84	1,995,990,748.49
负债和净资产总计		617,602,144.39	2,002,256,010.09

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.6211 元，基金份额总额 993,958,712.00

份。

7.2 利润表

会计主体：华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 11 月 22 日（基 金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		256,672,132.33	21,813,593.56
1. 利息收入		37,273.58	86,316.29
其中：存款利息收入	7.4.7.9	37,273.58	86,316.29
债券利息收入		-	-
资产支持证券 利息收入		-	-
买入返售金融 资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		164,898,789.65	14,364,110.88
其中：股票投资收益	7.4.7.10	137,179,940.55	12,150,327.77
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	-	-
资产支持证券 投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收 益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	27,718,849.10	2,213,783.11
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）	7.4.7.16	88,327,943.70	5,180,361.40
4. 汇兑收益（损失以 “-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以 “-”号填列）	7.4.7.17	3,408,125.40	2,182,804.99
减：二、营业总支出		2,926,052.41	482,650.08
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,959,541.06	330,126.55

其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	653,180.37	110,042.19
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.19	313,330.98	42,481.34
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		253,746,079.92	21,330,943.48
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		253,746,079.92	21,330,943.48
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		253,746,079.92	21,330,943.48

注：本产品成立于 2024 年 11 月 22 日，上年度可比期间为 2024 年 11 月 22 日至 2024 年 12 月 31 日。

7.3 净资产变动表

会计主体：华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 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	1,972,979,356.00	-	23,011,392.49	1,995,990,748.49
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,972,979,356.00	-	23,011,392.49	1,995,990,748.49
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-	97,313,604.36	-
	1,476,000,000.01			1,378,686,395.65

(一)、综合收益总额	-	-	253,746,079.92	253,746,079.92
(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)	1,476,000,000.01	-	-132,107,370.86	1,608,107,370.87
其中:1.基金申购款	1,658,999,999.99	-	14,853,428.49	1,673,853,428.48
2.基金赎回款	3,135,000,000.00	-	-146,960,799.35	3,281,960,799.35
(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)	-	-	-24,325,104.70	-24,325,104.70
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	496,979,355.99	-	120,324,996.85	617,304,352.84
项目	上年度可比期间 2024年11月22日(基金合同生效日)至2024年12月31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	1,999,979,356.00	-	-	1,999,979,356.00
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-27,000,000.00	-	23,011,392.49	-3,988,607.51
(一)、综合收益总额	-	-	21,330,943.48	21,330,943.48
(二)、本期基金份额交易产	-27,000,000.00	-	1,680,449.01	-25,319,550.99

生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）				
其中：1. 基金申购款	687,000,000.00	-	17,483,324.14	704,483,324.14
2. 基金赎回款	-714,000,000.00	-	-15,802,875.13	-729,802,875.13
（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	1,972,979,356.00	-	23,011,392.49	1,995,990,748.49

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2024]1526 号文《关于准予华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册，由华宝基金管理有限公司于 2024 年 11 月 5 日至 2024 年 11 月 18 日止期间向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2024）验字第 70072895_B05 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2024 年 11 月 22 日生效。本基金为交易型开放式，存续期限不定。设立时募集扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 1,999,953,201.00 元（含募集股票市值）；在募集期间产生利息为人民币 455,131.97 元（人民币 428,976.97 元归入基金财产）。以上共募集资金总额为人民币 2,000,408,332.97 元，折合 1,999,979,356.00 份基金份额。本基金的基金管理人为华宝基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为兴业银

行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会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、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、货币市场工具、股指期货、资产支持证券、债券回购以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与转融通证券出借业务和融资业务。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。

本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；股指期货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。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即中证 A500 指数收益率。

本财务报表已于 2026 年 3 月 25 日经本基金的基金管理人批准。

7.4.2 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）、中国证监会颁布的《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〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《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 7.4.4 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2025 年度和 2024 年 11 月 22 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 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 2025 年 12 月 31 日和 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度和 2024 年 11 月 22 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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。本财务报表的实际编制期间为 2025 年度和 2024 年 11 月 22 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 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商业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商业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。

7.4.4.4 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。

7.4.4.5 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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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)。

7.4.4.9 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。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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。本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点,本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提,收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 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。

(2) 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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的

通知》、财政部、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》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。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	1,388,678.92	10,824,984.05

等于：本金	1,388,458.21	10,823,444.53
加：应计利息	220.71	1,539.52
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
-	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	1,388,678.92	10,824,984.05

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	518,251,131.61	-	611,759,436.71	93,508,305.10
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	518,251,131.61	-	611,759,436.71	93,508,305.10
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,953,189,765.45	-	1,958,370,126.85	5,180,361.40
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市	-	-	-

	场				
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,953,189,765.45	-	1,958,370,126.85	5,180,361.40

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	-	-
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	168,000.00	17,071.34
应退替代款	-	5,849,780.68
可退替代款	1,576.20	2,599.20
其他	2,916.00	-
合计	172,492.20	5,869,451.22

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	1,972,979,356.00	1,972,979,356.00
本期申购	1,608,000,000.00	1,608,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-2,946,000,000.00	-2,946,000,000.00
2025年10月17日基金拆分/份额折算前	634,979,356.00	634,979,356.00
基金拆分/份额折算调整	634,979,356.00	-
本期申购	102,000,000.00	50,999,999.99
本期赎回（以“-”号填列）	-378,000,000.00	-189,000,000.00
本期末	993,958,712.00	496,979,355.99

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	15,821,990.69	7,189,401.80	23,011,392.49
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	15,821,990.69	7,189,401.80	23,011,392.49
本期利润	165,418,136.22	88,327,943.70	253,746,079.92
本期基金份额交易产生的变动数	-67,931,481.52	-64,175,889.34	-132,107,370.86
其中：基金申购款	29,489,901.57	-14,636,473.08	14,853,428.49
基金赎回款	-97,421,383.09	-49,539,416.26	-146,960,799.35
本期已分配利润	-24,325,104.70	-	-24,325,104.70
本期末	88,983,540.69	31,341,456.16	120,324,996.85

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年11月22日（基金合同生效日）至2024年12月31日
活期存款利息收入	23,290.95	65,611.50
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	10,049.41	20,704.79
其他	3,933.22	-
合计	37,273.58	86,316.29

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年11月22日（基金合同生效日）至2024年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	83,543,895.08	5,608,787.88
股票投资收益——赎回差价收入	53,636,045.47	6,541,539.89
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	137,179,940.55	12,150,327.77

7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年11月22日（基金合同生效日）至2024年12月31日
卖出股票成交总额	1,697,848,580.48	382,628,574.06
减：卖出股票成本总额	1,612,782,106.35	376,148,852.80
减：交易费用	1,522,579.05	870,933.38
买卖股票差价收入	83,543,895.08	5,608,787.88

7.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年11月22日（基金合同生效日）至2024年12月31日
赎回基金份额对价总额	3,281,960,799.35	729,802,875.13
减：现金支付赎回款总额	1,475,493,164.35	322,693,421.13
减：赎回股票成本总额	1,752,831,589.53	400,567,914.11
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	53,636,045.47	6,541,539.89

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益。

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.13 贵金属投资收益

7.4.7.13.1 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月 31日	上年度可比期间 2024年11月22日（基金合同 生效日）至2024年12月31日
股票投资产生的股利 收益	27,718,849.10	2,213,783.11
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	27,718,849.10	2,213,783.11

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年1月1日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年11月22日（基 金合同生效日）至2024年12 月31日
1. 交易性金融资产	88,327,943.70	5,180,361.40
股票投资	88,327,943.70	5,180,361.40
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价 值变动产生的预估增值税	-	-

合计	88,327,943.70	5,180,361.40
----	---------------	--------------

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年11月22日（基金合同生效日）至2024年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	3,408,125.40	1,753,828.02
其他	-	428,976.97
合计	3,408,125.40	2,182,804.99

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

7.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内及上年度可比期间无信用减值损失。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年11月22日（基金合同生效日）至2024年12月31日
审计费用	22,568.00	5,432.00
信息披露费	120,000.00	10,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	762.98	10.00
其他	-	400.00
IOPV 计算与发布费用	20,000.00	1,639.34
注册登记费用	150,000.00	25,000.00
合计	313,330.98	42,481.34

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于2026年2月11日宣告收益分配基准日为2026年1月30日的分红，向截至2026年2月13日止在本基金份额注册登记人登记在册的全体持有人，按每10份基金份额派发红利0.0470元。

7.4.9 关联方关系

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
兴业银行股份有限公司(“兴业银行”)	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
华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(“华宝中证 A500ETF 联接”)	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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年11月22日(基金 合同生效日)至2024年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,959,541.06	330,126.55
其中：应支付销售机构的客户维护费	213,600.19	52,589.25
应支付基金管理人的净管理费	1,745,940.87	277,537.30

注：支付基金管理人华宝基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年11月22日(基金 合同生效日)至2024年
----	---------------------------------	---

		12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	653,180.37	110,042.19

注：支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05%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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025年12月31日		上年度末 2024年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
华宝投资有 限公司	-	-	186,134,138.00	9.43
兴业银行股 份有限公司 — 华宝中证 A500 交易型 开放式指数 证券投资基 金联接基金	419,399,500.00	42.19	-	-

7.4.10.6 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 2025年1月1日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年11月22日（基金合同生效日）至 2024年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行	1,388,678.92	23,290.95	10,824,984.05	65,611.50

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 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。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期末本基金持有 73,100 股中国太保，期末公允价值为人民币 3,063,621 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.50%。（上年度末：本基金持有 295,500 股中国太保，期末公允价值为人民币 10,070,640 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.50%。）本报告期末本基金持有 358,300 股兴业银行，期末公允价值为人民币 7,545,798 元，占本基金期末基金资产净值比例为 1.22%。（上年度末：本基金持有 1,258,700 股兴业银行，期末公允价值为人民币 24,116,692 元，占本基金期末基金资产净值比例为 1.21%。）本报告期末本基金持有 184,900 股宝钢股份，期末公允价值为人民币 1,377,505 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.22%。（上年度末：本基金持有 761,400 股宝钢股份，期末公允价值为人民币 5,329,800 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.27%。）本报告期末本基金持有 18,400 股宝信软件，期末公允价值为人民币 381,064 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.06%。（上年度末：本基金持有 75,300 股宝信软件，期末公允价值为人民币 2,203,278 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.11%。）

除以上情况外，无其他需要说明的关联方交易事项。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益 登记 日	除息日		每 10 份基金 份额分 红数	现金形式 发放总额	再投 资形 式 发 放 总 额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2025 年 5 月 19 日	2025 年 5 月 20 日	-	0.0370	5,413,023.77	-	5,413,023.77	-
2	2025 年 8	2025 年 8	-	0.1260	11,175,940.55	-	11,175,940.55	-

	月 14 日	月 15 日						
3	2025 年 11 月 14 日	2025 年 11 月 17 日	-	0.0630	7,736,140.38	-	7,736,140.38	-
合计	-	-	-	0.2260	24,325,104.70	-	24,325,104.70	-

7.4.12 期末（2025 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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	56.94	160	2,468.80	9,110.40	-
001233	海安集团	2025 年 11 月 18 日	6 个月	新股锁定	48.00	51.88	370	17,760.00	19,195.60	-
001280	中国铝业	2025 年 11 月 25 日	6 个月	新股锁定	17.89	45.36	2,277	40,735.53	103,284.72	-
001285	瑞立科密	2025 年 9 月 23 日	6 个月	新股锁定	42.28	56.08	137	5,792.36	7,682.96	-
001369	双欣环保	2025 年 12 月 23 日	6 个月	新股锁定	6.85	12.89	897	6,144.45	11,562.33	-
001386	马可波罗	2025 年 10 月 15 日	6 个月	新股锁定	13.75	18.53	1,626	22,357.50	30,129.78	-
001388	信通	2025 年 6 月	6 个月	新股	16.42	42.94	94	1,543.48	4,036.36	-

	电子	月 24 日		锁定						
301449	天溯计量	2025 年 12 月 16 日	6 个月	新股锁定	36.80	65.23	112	4,121.60	7,305.76	-
301491	汉桑科技	2025 年 7 月 29 日	6 个月	新股锁定	28.91	55.11	245	7,082.95	13,501.95	-
301563	云汉芯城	2025 年 9 月 23 日	6 个月	新股锁定	27.00	133.69	110	2,970.00	14,705.90	-
301575	艾芬达	2025 年 9 月 3 日	6 个月	新股锁定	27.69	49.55	126	3,488.94	6,243.30	-
301584	建发致新	2025 年 9 月 18 日	6 个月	新股锁定	7.05	26.82	447	3,151.35	11,988.54	-
301609	山大电力	2025 年 7 月 16 日	6 个月	新股锁定	14.66	40.99	277	4,060.82	11,354.23	-
301632	广东建科	2025 年 8 月 5 日	6 个月	新股锁定	6.56	23.68	656	4,303.36	15,534.08	-
301638	南网数字	2025 年 11 月 11 日	6 个月	新股锁定	5.69	14.21	2,322	13,212.18	32,995.62	-
301656	联合动力	2025 年 9 月 17 日	6 个月	新股锁定	12.48	25.46	4,382	54,687.36	111,565.72	-
301667	纳百川	2025 年 12 月 10 日	6 个月	新股锁定	22.63	57.07	151	3,417.13	8,617.57	-
301668	昊创	2025 年 9 月	6 个月	新股	21.00	44.80	165	3,465.00	7,392.00	-

	瑞通	月 15 日		锁定						
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股锁定	21.93	54.39	195	4,276.35	10,606.05	-
601026	道生天合	2025 年 10 月 9 日	6 个月	新股锁定	5.98	14.28	451	2,696.98	6,440.28	-
603092	德力佳	2025 年 10 月 30 日	6 个月	新股锁定	46.68	55.66	146	6,815.28	8,126.36	-
603175	超颖电子	2025 年 10 月 17 日	6 个月	新股锁定	17.08	48.56	169	2,886.52	8,206.64	-
603248	锡华科技	2025 年 12 月 16 日	6 个月	新股锁定	10.10	16.30	260	2,626.00	4,238.00	-
603262	技源集团	2025 年 7 月 16 日	6 个月	新股锁定	10.88	28.10	155	1,686.40	4,355.50	-
603334	丰倍生物	2025 年 10 月 29 日	6 个月	新股锁定	24.49	32.82	88	2,155.12	2,888.16	-
603370	华新精科	2025 年 8 月 27 日	6 个月	新股锁定	18.60	46.35	82	1,525.20	3,800.70	-
603376	大明电子	2025 年 10 月 28 日	6 个月	新股锁定	12.55	26.21	111	1,393.05	2,909.31	-
603406	天富龙	2025 年 7 月 30 日	6 个月	新股锁定	23.60	40.16	153	3,610.80	6,144.48	-
603418	友升	2025 年 9 月	6 个月	新股	46.36	59.06	139	6,444.04	8,209.34	-

	股份	月 16 日		锁定						
688729	屹唐股份	2025 年 7 月 1 日	6 个月	新股锁定	8.45	24.28	3,505	29,617.25	85,101.40	-
688759	必贝特	2025 年 10 月 21 日	9 个月	新股锁定	17.78	25.13	12,552	223,174.56	315,431.76	-
688790	昂瑞微	2025 年 12 月 9 日	9 个月	新股锁定	83.06	117.07	1,913	158,893.78	223,954.91	-
688795	摩尔线程	2025 年 11 月 26 日	9 个月	新股锁定	114.28	416.02	2,560	292,556.80	1,065,011.20	-
688796	百奥赛图	2025 年 12 月 2 日	6 个月	新股锁定	26.68	42.25	423	11,285.64	17,871.75	-
688802	沐曦股份	2025 年 12 月 9 日	9 个月	新股锁定	104.66	399.40	1,764	184,620.24	704,541.60	-
688807	优迅股份	2025 年 12 月 10 日	6 个月	新股锁定	51.66	135.56	131	6,767.46	17,758.36	-
688809	强一股份	2025 年 12 月 23 日	6 个月	新股锁定	85.09	203.31	184	15,656.56	37,409.04	-

7.4.12.2 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	复牌开盘价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688012	中微公司	2025 年 12 月	重大事项停牌	272.72	2026 年 1 月 5 日	278.00	10,256	2,132,688.42	2,797,016.32	-

		19 日								
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	14,360	998,314.70	1,131,711.60	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为 ETF 基金，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。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之内。

7.4.13.2 信用风险

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

7.4.13.3 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来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

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

7.4.13.3.1 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上市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股票不得超过该上市公司可流通股股票的 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股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

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

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

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

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

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

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率

敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,388,678.92	-	-	-	1,388,678.92
结算备付金	4,454,028.76	-	-	-	4,454,028.76
交易性金融资产	-	-	-	611,759,436.71	611,759,436.71
资产总计	5,842,707.68	-	-	611,759,436.71	617,602,144.39
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	83,850.24	83,850.24
应付托管费	-	-	-	27,950.09	27,950.09
应付清算款	-	-	-	13,499.02	13,499.02
其他负债	-	-	-	172,492.20	172,492.20
负债总计	-	-	-	297,791.55	297,791.55
利率敏感度缺口	5,842,707.68	-	-	611,461,645.16	617,304,352.84
上年度末 2024 年 12 月 31 日					
资产					
货币资金	10,824,984.05	-	-	-	10,824,984.05
结算备付金	33,060,899.19	-	-	-	33,060,899.19
交易性金融资产	-	-	-	1,958,370,126.85	1,958,370,126.85
资产总计	43,885,883.24	-	-	1,958,370,126.85	2,002,256,010.09
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	264,368.03	264,368.03
应付托管费	-	-	-	88,122.68	88,122.68
应付清算款	-	-	-	43,319.67	43,319.67
其他负债	-	-	-	5,869,451.22	5,869,451.22
负债总计	-	-	-	6,265,261.60	6,265,261.60
利率敏感度缺口	43,885,883.24	-	-	1,952,104,865.25	1,995,990,748.49

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早

者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，以复制、跟踪中证 A500 指数的方法为原则，根据标的指数成份股票在指数中的权重确定成份股票的买卖数量，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。在因特殊情况（如成份股停牌、流动性不足、法规法律限制等）导致无法获得足够数量的股票时，本基金可以根据市场情况，结合经验判断，综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股、备选成份股等进行替代，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。本基金采用完全复制法进行指数化投资，股票资产跟踪的标的指数为中证 A500 指数，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资于中证 A500 指数的成份股和备选成份股的资产比例不低于该基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量于国内依法发行上市的非成份股、债券、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券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。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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日		上年度末 2024 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	611,759,436.71	99.10	1,958,370,126.85	98.12

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	611,759,436.71	99.10	1,958,370,126.85	98.12

7.4.13.4.3.2 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（2025年12月31日）	上年度末（2024年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	30,548,787.86	-
	业绩比较基准下降5%	-30,548,787.86	-

注：于上年度末，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	604,871,497.13	1,955,404,872.85

第二层次	3,928,727.92	2,965,254.00
第三层次	2,959,211.66	-
合计	611,759,436.71	1,958,370,126.85

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	3,771,354.49	3,771,354.49
转出第三层次	-	380,574.22	380,574.22
当期利得或损失总额	-	-431,568.61	-431,568.61
其中：计入损益的利得或损失	-	-431,568.61	-431,568.61
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	2,959,211.66	2,959,211.66
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-494,968.95	-494,968.95
项目	上年度可比期间 2024年11月22日（基金合同生效日）至2024年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-

当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	2,959,211.66	平均价格亚式期权模型	预期波动率	18.00%~303.23%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期末无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	611,759,436.71	99.05
	其中：股票	611,759,436.71	99.05
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	5,842,707.68	0.95
8	其他各项资产	-	-
9	合计	617,602,144.39	100.00

注：1、此处股票投资项含可退替代款估值增值，而“报告期末按行业分类的股票投资组合”的合计项不含可退替代款估值增值，两者在金额上可能不相等。

2、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），“其他各项资产”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）。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	3,113,694.00	0.50
B	采矿业	35,407,854.20	5.74
C	制造业	380,909,066.47	61.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	14,677,028.00	2.38
E	建筑业	9,029,311.00	1.46
F	批发和零售业	3,926,837.00	0.64
G	交通运输、仓储和邮政业	16,753,777.00	2.71
H	住宿和餐饮业	461,930.00	0.07

I	信息传输、软件和信息技术服务业	37,617,444.22	6.09
J	金融业	83,180,924.87	13.47
K	房地产业	5,053,044.00	0.82
L	租赁和商务服务业	6,824,203.80	1.11
M	科学研究和技术服务业	6,798,133.00	1.10
N	水利、环境和公共设施管理业	1,249,008.48	0.20
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	287,974.00	0.05
Q	卫生和社会工作	1,663,849.01	0.27
R	文化、体育和娱乐业	1,132,872.00	0.18
S	综合	713,274.00	0.12
	合计	608,800,225.05	98.62

8.2.2 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	103,284.72	0.02
C	制造业	2,755,525.29	0.45
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	26,694.44	0.00
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	32,995.62	0.01
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	40,711.59	0.01
N	水利、环境和公	-	-

	共设施管理业		
0	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	2,959,211.66	0.48

8.2.3 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。

8.3 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

8.3.1 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	56,705	20,825,478.30	3.37
2	600519	贵州茅台	13,000	17,903,340.00	2.90
3	601318	中国平安	225,400	15,417,360.00	2.50
4	300308	中际旭创	24,200	14,762,000.00	2.39
5	601899	紫金矿业	349,200	12,036,924.00	1.95
6	600036	招商银行	262,101	11,034,452.10	1.79
7	300502	新易盛	21,480	9,255,302.40	1.50
8	000333	美的集团	104,800	8,190,120.00	1.33
9	601166	兴业银行	358,300	7,545,798.00	1.22
10	600900	长江电力	258,700	7,034,053.00	1.14
11	688256	寒武纪	4,952	6,712,683.60	1.09
12	300059	东方财富	268,300	6,219,194.00	1.01
13	002475	立讯精密	107,268	6,083,168.28	0.99
14	600030	中信证券	206,500	5,928,615.00	0.96
15	600276	恒瑞医药	94,200	5,611,494.00	0.91
16	002594	比亚迪	56,700	5,540,724.00	0.90
17	601398	工商银行	684,800	5,430,464.00	0.88
18	300274	阳光电源	30,500	5,216,720.00	0.85
19	688981	中芯国际	41,551	5,103,709.33	0.83
20	601211	国泰海通	238,600	4,903,230.00	0.79
21	688041	海光信息	21,609	4,849,275.69	0.79
22	603259	药明康德	52,700	4,776,728.00	0.77
23	601288	农业银行	608,600	4,674,048.00	0.76
24	002371	北方华创	10,020	4,599,981.60	0.75
25	000858	五粮液	40,300	4,269,382.00	0.69

26	601328	交通银行	564,025	4,089,181.25	0.66
27	600887	伊利股份	134,200	3,838,120.00	0.62
28	000651	格力电器	94,500	3,800,790.00	0.62
29	603993	洛阳钼业	185,300	3,706,000.00	0.60
30	300476	胜宏科技	12,600	3,623,508.00	0.59
31	600000	浦发银行	282,458	3,513,777.52	0.57
32	000725	京东方 A	776,700	3,269,907.00	0.53
33	601816	京沪高铁	621,500	3,200,725.00	0.52
34	600150	中国船舶	95,303	3,169,777.78	0.51
35	600309	万华化学	40,500	3,105,540.00	0.50
36	300124	汇川技术	40,700	3,065,931.00	0.50
37	601601	中国太保	73,100	3,063,621.00	0.50
38	603986	兆易创新	13,900	2,978,075.00	0.48
39	002714	牧原股份	57,100	2,888,118.00	0.47
40	601088	中国神华	70,300	2,847,150.00	0.46
41	688012	中微公司	10,256	2,797,016.32	0.45
42	688008	澜起科技	23,210	2,734,138.00	0.44
43	300760	迈瑞医疗	14,100	2,685,345.00	0.44
44	600031	三一重工	125,100	2,643,363.00	0.43
45	603019	中科曙光	30,800	2,637,712.00	0.43
46	000063	中兴通讯	69,500	2,629,880.00	0.43
47	002050	三花智控	47,200	2,610,632.00	0.42
48	601857	中国石油	239,400	2,492,154.00	0.40
49	600111	北方稀土	54,000	2,490,480.00	0.40
50	002230	科大讯飞	48,900	2,459,181.00	0.40
51	600089	特变电工	106,900	2,375,318.00	0.38
52	000001	平安银行	204,700	2,335,627.00	0.38
53	601012	隆基绿能	128,076	2,330,983.20	0.38
54	000425	徐工机械	199,300	2,307,894.00	0.37
55	002415	海康威视	77,200	2,303,648.00	0.37
56	603501	豪威集团	18,100	2,278,790.00	0.37
57	002384	东山精密	26,600	2,251,690.00	0.36
58	601668	中国建筑	437,000	2,241,810.00	0.36
59	600660	福耀玻璃	34,000	2,202,180.00	0.36
60	603799	华友钴业	32,100	2,191,146.00	0.35
61	601127	赛力斯	17,800	2,153,088.00	0.35
62	601728	中国电信	328,900	2,072,070.00	0.34
63	600690	海尔智家	79,200	2,066,328.00	0.33
64	601600	中国铝业	168,200	2,055,404.00	0.33
65	002463	沪电股份	28,100	2,053,267.00	0.33
66	601919	中远海控	133,700	2,029,566.00	0.33
67	000100	TCL 科技	440,200	1,998,508.00	0.32
68	601888	中国中免	21,100	1,995,216.00	0.32

69	002028	思源电气	12,900	1,994,211.00	0.32
70	000338	潍柴动力	114,700	1,972,840.00	0.32
71	600941	中国移动	19,400	1,960,370.00	0.32
72	002352	顺丰控股	51,000	1,954,320.00	0.32
73	600406	国电南瑞	85,300	1,917,544.00	0.31
74	600028	中国石化	308,300	1,905,294.00	0.31
75	000792	盐湖股份	67,400	1,897,984.00	0.31
76	300394	天孚通信	9,200	1,867,876.00	0.30
77	600418	江淮汽车	37,400	1,851,300.00	0.30
78	000568	泸州老窖	15,500	1,801,410.00	0.29
79	600183	生益科技	25,000	1,785,250.00	0.29
80	601766	中国中车	257,100	1,753,422.00	0.28
81	601225	陕西煤业	82,100	1,750,372.00	0.28
82	601988	中国银行	302,300	1,732,179.00	0.28
83	000988	华工科技	21,800	1,729,394.00	0.28
84	688111	金山办公	5,579	1,713,143.53	0.28
85	600050	中国联通	331,300	1,692,943.00	0.27
86	300014	亿纬锂能	25,700	1,690,032.00	0.27
87	601628	中国人寿	35,500	1,615,250.00	0.26
88	300033	同花顺	5,000	1,610,900.00	0.26
89	002027	分众传媒	214,200	1,578,654.00	0.26
90	002625	光启技术	31,900	1,555,444.00	0.25
91	002460	赣锋锂业	24,700	1,553,383.00	0.25
92	600938	中国海油	50,800	1,533,144.00	0.25
93	002241	歌尔股份	52,900	1,519,817.00	0.25
94	600547	山东黄金	38,800	1,501,948.00	0.24
95	601985	中国核电	173,600	1,501,640.00	0.24
96	000977	浪潮信息	22,300	1,485,180.00	0.24
97	600104	上汽集团	97,300	1,480,906.00	0.24
98	688271	联影医疗	11,593	1,454,921.50	0.24
99	002916	深南电路	6,210	1,442,520.90	0.23
100	601689	拓普集团	18,600	1,435,548.00	0.23
101	000807	云铝股份	43,600	1,431,824.00	0.23
102	600489	中金黄金	61,200	1,429,632.00	0.23
103	000408	藏格矿业	16,600	1,401,040.00	0.23
104	600019	宝钢股份	184,900	1,377,505.00	0.22
105	603288	海天味业	35,615	1,318,467.30	0.21
106	601006	大秦铁路	255,400	1,317,864.00	0.21
107	300136	信维通信	20,900	1,295,800.00	0.21
108	002709	天赐材料	27,900	1,292,607.00	0.21
109	605499	东鹏饮料	4,800	1,283,472.00	0.21
110	300408	三环集团	28,000	1,281,000.00	0.21
111	601658	邮储银行	233,900	1,274,755.00	0.21

112	002837	英维克	11,900	1,271,991.00	0.21
113	688072	拓荆科技	3,854	1,271,820.00	0.21
114	300433	蓝思科技	41,500	1,256,205.00	0.20
115	000625	长安汽车	105,800	1,254,788.00	0.20
116	002466	天齐锂业	22,400	1,240,512.00	0.20
117	600362	江西铜业	22,500	1,235,700.00	0.20
118	600905	三峡能源	301,800	1,234,362.00	0.20
119	002558	巨人网络	28,300	1,225,107.00	0.20
120	600879	航天电子	56,500	1,204,580.00	0.20
121	601100	恒立液压	10,900	1,198,019.00	0.19
122	300450	先导智能	23,900	1,194,522.00	0.19
123	002738	中矿资源	15,200	1,193,960.00	0.19
124	600436	片仔癀	7,000	1,181,460.00	0.19
125	601390	中国中铁	217,200	1,175,052.00	0.19
126	688521	芯原股份	8,555	1,171,778.35	0.19
127	600580	卧龙电驱	23,800	1,168,580.00	0.19
128	600438	通威股份	56,400	1,157,328.00	0.19
129	601727	上海电气	133,800	1,152,018.00	0.19
130	600010	包钢股份	479,900	1,142,162.00	0.19
131	600118	中国卫星	12,000	1,139,400.00	0.18
132	600584	长电科技	30,800	1,132,824.00	0.18
133	002049	紫光国微	14,360	1,131,711.60	0.18
134	600585	海螺水泥	51,000	1,114,860.00	0.18
135	600893	航发动力	27,800	1,112,834.00	0.18
136	600988	赤峰黄金	35,500	1,109,020.00	0.18
137	300015	爱尔眼科	98,800	1,084,824.00	0.18
138	000538	云南白药	19,100	1,084,116.00	0.18
139	600160	巨化股份	28,200	1,083,444.00	0.18
140	600115	中国东航	180,200	1,081,200.00	0.18
141	000426	兴业银锡	29,800	1,060,880.00	0.17
142	600522	中天科技	57,100	1,034,652.00	0.17
143	000630	铜陵有色	171,000	1,027,710.00	0.17
144	000938	紫光股份	41,700	1,025,820.00	0.17
145	600760	中航沈飞	18,200	1,021,930.00	0.17
146	600487	亨通光电	41,100	1,016,403.00	0.16
147	600346	恒力石化	44,300	998,079.00	0.16
148	600549	厦门钨业	24,200	993,652.00	0.16
149	601168	西部矿业	35,600	983,984.00	0.16
150	600426	华鲁恒升	31,300	983,759.00	0.16
151	600570	恒生电子	32,000	964,800.00	0.16
152	601669	中国电建	182,600	949,520.00	0.15
153	600795	国电电力	188,100	948,024.00	0.15
154	002532	天山铝业	58,500	946,530.00	0.15

155	002156	通富微电	25,000	942,500.00	0.15
156	002202	金风科技	45,700	932,280.00	0.15
157	002179	中航光电	26,300	932,072.00	0.15
158	600048	保利发展	152,500	930,250.00	0.15
159	002074	国轩高科	23,600	922,996.00	0.15
160	300442	润泽科技	17,400	918,720.00	0.15
161	000933	神火股份	33,400	917,498.00	0.15
162	600029	南方航空	114,100	913,941.00	0.15
163	600415	小商品城	57,300	913,935.00	0.15
164	000157	中联重科	105,800	913,054.00	0.15
165	601058	赛轮轮胎	56,300	910,934.00	0.15
166	600989	宝丰能源	46,300	908,869.00	0.15
167	600066	宇通客车	27,700	905,790.00	0.15
168	002340	格林美	107,700	900,372.00	0.15
169	002353	杰瑞股份	12,700	899,541.00	0.15
170	688126	沪硅产业	41,349	894,792.36	0.14
171	600096	云天化	26,500	885,365.00	0.14
172	688036	传音控股	13,370	884,559.20	0.14
173	300604	长川科技	8,700	881,397.00	0.14
174	300803	指南针	6,700	876,829.00	0.14
175	000547	航天发展	26,500	874,765.00	0.14
176	688002	睿创微纳	8,652	872,121.60	0.14
177	600176	中国巨石	51,000	872,100.00	0.14
178	300058	蓝色光标	75,440	869,068.80	0.14
179	688120	华海清科	5,783	867,912.64	0.14
180	000975	山金国际	35,500	863,715.00	0.14
181	600143	金发科技	44,200	863,668.00	0.14
182	002195	岩山科技	120,600	855,054.00	0.14
183	600009	上海机场	25,700	841,932.00	0.14
184	300339	润和软件	16,900	836,550.00	0.14
185	002407	多氟多	24,500	830,795.00	0.13
186	601360	三六零	73,300	818,761.00	0.13
187	002001	新和成	32,500	818,675.00	0.13
188	300207	欣旺达	31,200	815,880.00	0.13
189	300395	菲利华	8,100	812,430.00	0.13
190	002131	利欧股份	143,000	806,520.00	0.13
191	300751	迈为股份	3,900	803,361.00	0.13
192	688122	西部超导	10,732	800,392.56	0.13
193	002517	恺英网络	36,500	798,255.00	0.13
194	600219	南山铝业	147,600	794,088.00	0.13
195	300418	昆仑万维	18,800	783,960.00	0.13
196	002236	大华股份	41,000	776,540.00	0.13
197	002851	麦格米特	8,600	774,602.00	0.13

198	002555	三七互娱	32,800	774,080.00	0.13
199	002436	兴森科技	36,300	768,471.00	0.12
200	002456	欧菲光	71,600	760,392.00	0.12
201	601186	中国铁建	97,300	746,291.00	0.12
202	688169	石头科技	4,905	745,854.30	0.12
203	688235	百济神州	2,771	744,290.60	0.12
204	000963	华东医药	18,800	741,660.00	0.12
205	002493	荣盛石化	63,300	741,243.00	0.12
206	601111	中国国航	79,100	741,167.00	0.12
207	000768	中航西飞	29,100	738,558.00	0.12
208	002938	鹏鼎控股	14,600	738,468.00	0.12
209	002273	水晶光电	29,143	732,072.16	0.12
210	000831	中国稀土	15,700	729,108.00	0.12
211	600885	宏发股份	23,920	727,168.00	0.12
212	688777	中控技术	14,711	725,840.74	0.12
213	600157	永泰能源	462,300	725,811.00	0.12
214	002008	大族激光	17,500	720,825.00	0.12
215	600895	张江高科	16,400	719,960.00	0.12
216	002812	恩捷股份	12,700	719,328.00	0.12
217	002422	科伦药业	24,400	716,140.00	0.12
218	600673	东阳光	31,800	713,274.00	0.12
219	002252	上海莱士	112,200	711,348.00	0.12
220	600839	四川长虹	77,800	707,980.00	0.11
221	002601	龙佰集团	35,600	697,048.00	0.11
222	688099	晶晨股份	7,988	696,793.24	0.11
223	603129	春风动力	2,500	696,700.00	0.11
224	600196	复星医药	26,300	696,687.00	0.11
225	600745	闻泰科技	18,600	693,408.00	0.11
226	600011	华能国际	92,600	690,796.00	0.11
227	600372	中航机载	51,400	689,788.00	0.11
228	002130	沃尔核材	26,100	686,952.00	0.11
229	002128	电投能源	24,400	681,004.00	0.11
230	600460	士兰微	23,900	678,999.00	0.11
231	002472	双环传动	14,200	673,222.00	0.11
232	002281	光迅科技	9,600	671,520.00	0.11
233	000002	万科 A	143,800	668,670.00	0.11
234	300223	北京君正	6,300	668,052.00	0.11
235	600741	华域汽车	33,400	668,000.00	0.11
236	600699	均胜电子	21,100	661,696.00	0.11
237	301236	软通动力	13,900	659,277.00	0.11
238	600886	国投电力	50,200	658,624.00	0.11
239	001979	招商蛇口	75,800	654,912.00	0.11
240	688396	华润微	12,368	653,772.48	0.11

241	601877	正泰电器	23,400	652,626.00	0.11
242	002595	豪迈科技	7,700	650,727.00	0.11
243	002465	海格通信	41,300	650,475.00	0.11
244	300390	天华新能	11,900	649,859.00	0.11
245	600515	海南机场	121,600	648,128.00	0.10
246	688578	艾力斯	6,200	645,730.00	0.10
247	601868	中国能建	274,300	644,605.00	0.10
248	688608	恒玄科技	2,840	644,509.60	0.10
249	002920	德赛西威	5,300	637,590.00	0.10
250	688213	思特威	6,705	637,578.45	0.10
251	300759	康龙化成	22,400	636,832.00	0.10
252	002648	卫星化学	35,900	634,712.00	0.10
253	603659	璞泰来	23,200	634,288.00	0.10
254	600392	盛和资源	29,347	631,840.91	0.10
255	688506	百利天恒	1,950	630,045.00	0.10
256	003816	中国广核	166,800	627,168.00	0.10
257	300346	南大光电	14,480	621,192.00	0.10
258	000301	东方盛虹	56,700	617,463.00	0.10
259	601872	招商轮船	68,700	616,926.00	0.10
260	601800	中国交建	74,700	615,528.00	0.10
261	688047	龙芯中科	4,620	610,348.20	0.10
262	601319	中国人保	67,900	607,705.00	0.10
263	002138	顺络电子	17,100	607,563.00	0.10
264	000878	云南铜业	29,400	602,994.00	0.10
265	300054	鼎龙股份	16,000	601,600.00	0.10
266	002185	华天科技	54,800	601,156.00	0.10
267	600233	圆通速递	36,600	600,972.00	0.10
268	000960	锡业股份	21,400	596,632.00	0.10
269	002497	雅化集团	24,000	594,000.00	0.10
270	600352	浙江龙盛	55,700	593,762.00	0.10
271	605117	德业股份	6,880	593,056.00	0.10
272	002129	TCL 中环	68,825	589,830.25	0.10
273	300347	泰格医药	10,400	589,680.00	0.10
274	601633	长城汽车	25,800	583,854.00	0.09
275	601021	春秋航空	9,804	583,338.00	0.09
276	301358	湖南裕能	9,000	581,940.00	0.09
277	300782	卓胜微	7,136	581,441.28	0.09
278	601117	中国化学	77,200	581,316.00	0.09
279	300661	圣邦股份	8,460	580,694.40	0.09
280	000066	中国长城	40,200	579,282.00	0.09
281	688017	绿的谐波	2,983	573,034.30	0.09
282	300866	安克创新	5,000	571,950.00	0.09
283	600588	用友网络	42,900	568,854.00	0.09

284	002294	信立泰	11,400	564,870.00	0.09
285	002078	太阳纸业	35,800	563,850.00	0.09
286	600141	兴发集团	16,300	563,654.00	0.09
287	600674	川投能源	40,500	562,950.00	0.09
288	601615	明阳智能	38,800	561,824.00	0.09
289	002271	东方雨虹	41,200	559,908.00	0.09
290	600498	烽火通信	17,400	558,192.00	0.09
291	300037	新宙邦	10,600	555,440.00	0.09
292	000661	长春高新	6,000	555,300.00	0.09
293	600039	四川路桥	55,800	555,210.00	0.09
294	000786	北新建材	22,100	551,837.00	0.09
295	603979	金诚信	7,100	540,665.00	0.09
296	300017	网宿科技	52,400	537,100.00	0.09
297	300757	罗博特科	2,300	536,590.00	0.09
298	002414	高德红外	36,500	535,455.00	0.09
299	300972	万辰集团	2,600	522,782.00	0.08
300	601233	桐昆股份	30,300	521,463.00	0.08
301	000617	中油资本	54,000	518,400.00	0.08
302	002444	巨星科技	15,100	513,702.00	0.08
303	600482	中国动力	24,600	509,220.00	0.08
304	300251	光线传媒	30,900	506,142.00	0.08
305	688617	惠泰医疗	2,079	505,758.33	0.08
306	002155	湖南黄金	23,780	501,520.20	0.08
307	002085	万丰奥威	31,300	501,113.00	0.08
308	300316	晶盛机电	13,600	499,800.00	0.08
309	601179	中国西电	54,800	498,680.00	0.08
310	300474	景嘉微	6,900	495,903.00	0.08
311	300454	深信服	4,300	495,188.00	0.08
312	300896	爱美客	3,480	493,185.60	0.08
313	300073	当升科技	8,500	491,300.00	0.08
314	300748	金力永磁	14,300	487,773.00	0.08
315	300012	华测检测	35,900	486,445.00	0.08
316	688223	晶科能源	85,015	479,484.60	0.08
317	603606	东方电缆	8,000	478,000.00	0.08
318	002459	晶澳科技	41,400	474,030.00	0.08
319	002223	鱼跃医疗	12,400	473,804.00	0.08
320	300496	中科创达	7,000	472,500.00	0.08
321	300002	神州泰岳	40,900	471,168.00	0.08
322	300024	机器人	25,900	471,121.00	0.08
323	300699	光威复材	11,900	469,574.00	0.08
324	300724	捷佳伟创	4,900	468,440.00	0.08
325	600497	驰宏锌锗	63,900	467,109.00	0.08
326	002624	完美世界	28,400	465,476.00	0.08

327	600256	广汇能源	94,400	464,448.00	0.08
328	300122	智飞生物	24,600	464,202.00	0.08
329	688472	阿特斯	31,088	463,522.08	0.08
330	300285	国瓷材料	16,900	463,229.00	0.08
331	600085	同仁堂	14,300	461,318.00	0.07
332	600765	中航重机	24,000	459,840.00	0.07
333	603087	甘李药业	6,700	456,069.00	0.07
334	002064	华峰化学	41,300	454,300.00	0.07
335	002405	四维图新	50,300	453,203.00	0.07
336	688599	天合光能	27,288	451,616.40	0.07
337	000034	神州数码	11,600	451,356.00	0.07
338	601618	中国中冶	151,600	450,252.00	0.07
339	002410	广联达	35,200	442,816.00	0.07
340	000423	东阿阿胶	8,900	436,812.00	0.07
341	603486	科沃斯	5,400	435,672.00	0.07
342	002180	纳思达	21,500	434,730.00	0.07
343	601607	上海医药	24,300	433,998.00	0.07
344	002065	东华软件	47,400	433,710.00	0.07
345	300919	中伟股份	9,300	430,869.00	0.07
346	001965	招商公路	42,600	429,408.00	0.07
347	300568	星源材质	28,100	428,525.00	0.07
348	002821	凯莱英	4,600	427,478.00	0.07
349	688180	君实生物	12,513	427,444.08	0.07
350	002245	蔚蓝锂芯	24,000	427,200.00	0.07
351	603596	伯特利	8,300	425,541.00	0.07
352	300003	乐普医疗	26,800	423,708.00	0.07
353	300832	新产业	7,500	421,875.00	0.07
354	600862	中航高科	17,800	420,614.00	0.07
355	688266	泽璟制药	4,506	417,706.20	0.07
356	688065	凯赛生物	8,382	417,423.60	0.07
357	688005	容百科技	11,748	415,879.20	0.07
358	600026	中远海能	35,600	415,808.00	0.07
359	000932	华菱钢铁	73,900	415,318.00	0.07
360	600803	新奥股份	20,000	415,200.00	0.07
361	600637	东方明珠	42,100	414,685.00	0.07
362	000683	博源化工	55,700	414,408.00	0.07
363	000830	鲁西化工	25,000	414,250.00	0.07
364	002318	久立特材	14,300	413,985.00	0.07
365	302132	中航成飞	5,200	410,800.00	0.07
366	601799	星宇股份	3,300	407,121.00	0.07
367	000623	吉林敖东	20,600	402,318.00	0.07
368	688303	大全能源	14,958	401,173.56	0.06
369	300001	特锐德	15,600	400,608.00	0.06

370	000039	中集集团	39,600	399,564.00	0.06
371	605589	圣泉集团	14,100	399,030.00	0.06
372	600486	扬农化工	5,700	395,523.00	0.06
373	000999	华润三九	13,840	393,886.40	0.06
374	002756	永兴材料	7,200	390,600.00	0.06
375	300627	华测导航	11,180	390,293.80	0.06
376	000887	中鼎股份	16,800	389,928.00	0.06
377	000733	振华科技	7,400	387,834.00	0.06
378	600521	华海药业	22,800	386,916.00	0.06
379	300413	芒果超媒	15,800	385,836.00	0.06
380	000400	许继电气	15,000	385,650.00	0.06
381	000009	中国宝安	38,800	382,180.00	0.06
382	601238	广汽集团	46,700	381,072.00	0.06
383	600845	宝信软件	18,400	381,064.00	0.06
384	601677	明泰铝业	25,700	380,103.00	0.06
385	600332	白云山	14,700	378,378.00	0.06
386	300383	光环新网	30,200	377,802.00	0.06
387	688188	柏楚电子	2,779	377,638.31	0.06
388	603605	珀莱雅	5,500	376,640.00	0.06
389	600177	雅戈尔	48,900	371,640.00	0.06
390	300142	沃森生物	34,000	370,940.00	0.06
391	002409	雅克科技	5,000	370,500.00	0.06
392	600704	物产中大	65,700	365,949.00	0.06
393	300628	亿联网络	10,200	363,630.00	0.06
394	002007	华兰生物	23,900	361,607.00	0.06
395	603568	伟明环保	14,200	360,396.00	0.06
396	000708	中信特钢	21,900	358,503.00	0.06
397	002152	广电运通	25,900	357,679.00	0.06
398	000738	航发控制	16,700	355,877.00	0.06
399	002176	江特电机	36,500	355,510.00	0.06
400	002739	万达电影	31,200	353,184.00	0.06
401	300438	鹏辉能源	6,600	351,252.00	0.06
402	002044	美年健康	66,400	350,592.00	0.06
403	600161	天坛生物	21,400	349,676.00	0.06
404	600499	科达制造	25,100	348,137.00	0.06
405	603260	合盛硅业	6,600	347,820.00	0.06
406	601216	君正集团	72,000	347,040.00	0.06
407	600208	衢州发展	89,300	345,591.00	0.06
408	002389	航天彩虹	14,400	345,312.00	0.06
409	600153	建发股份	37,200	344,100.00	0.06
410	601567	三星医疗	14,700	338,394.00	0.05
411	300459	汤姆猫	73,700	338,283.00	0.05
412	688166	博瑞医药	6,884	337,729.04	0.05

413	600516	方大炭素	59,100	336,279.00	0.05
414	300253	卫宁健康	38,000	335,160.00	0.05
415	300083	创世纪	35,500	326,955.00	0.05
416	600563	法拉电子	3,100	325,345.00	0.05
417	300068	南都电源	20,900	324,786.00	0.05
418	000519	中兵红箭	17,800	324,138.00	0.05
419	603392	万泰生物	7,200	323,568.00	0.05
420	300088	长信科技	53,300	322,998.00	0.05
421	002841	视源股份	8,100	321,003.00	0.05
422	600018	上港集团	58,500	317,070.00	0.05
423	603806	福斯特	22,700	316,892.00	0.05
424	000415	渤海租赁	78,200	316,710.00	0.05
425	300763	锦浪科技	4,400	314,204.00	0.05
426	600398	海澜之家	51,000	308,550.00	0.05
427	300676	华大基因	6,800	308,448.00	0.05
428	000629	钒钛股份	98,400	305,040.00	0.05
429	603816	顾家家居	9,900	304,326.00	0.05
430	002603	以岭药业	17,800	303,846.00	0.05
431	688009	中国通号	55,504	303,606.88	0.05
432	600820	隧道股份	46,400	301,136.00	0.05
433	600312	平高电气	17,300	300,155.00	0.05
434	601018	宁波港	82,400	299,112.00	0.05
435	600170	上海建工	112,700	298,655.00	0.05
436	603077	和邦生物	130,900	295,834.00	0.05
437	600166	福田汽车	100,800	294,336.00	0.05
438	600316	洪都航空	8,400	293,244.00	0.05
439	002607	中公教育	105,100	287,974.00	0.05
440	300118	东方日升	19,600	287,336.00	0.05
441	600038	中直股份	7,900	285,427.00	0.05
442	600323	瀚蓝环境	9,800	280,280.00	0.05
443	002145	钛能化学	57,100	279,790.00	0.05
444	300573	兴齐眼药	3,980	279,754.20	0.05
445	600008	首创环保	92,800	278,400.00	0.05
446	603885	吉祥航空	18,700	278,256.00	0.05
447	300558	贝达药业	5,900	275,471.00	0.04
448	600998	九州通	53,800	275,456.00	0.04
449	600529	山东药玻	13,800	275,034.00	0.04
450	300567	精测电子	3,000	273,600.00	0.04
451	300144	宋城演艺	33,400	273,546.00	0.04
452	002544	普天科技	7,900	272,471.00	0.04
453	603939	益丰药房	12,500	271,500.00	0.04
454	601155	新城控股	19,400	270,630.00	0.04
455	002312	川发龙蟒	24,700	269,971.00	0.04

456	600859	王府井	16,700	259,351.00	0.04
457	002244	滨江集团	25,700	258,285.00	0.04
458	688390	固德威	4,080	253,490.40	0.04
459	603650	彤程新材	5,700	251,598.00	0.04
460	601880	辽港股份	155,200	248,320.00	0.04
461	600667	太极实业	30,800	245,476.00	0.04
462	002025	航天电器	4,800	240,624.00	0.04
463	002432	九安医疗	6,000	240,240.00	0.04
464	601000	唐山港	62,500	240,000.00	0.04
465	600535	天士力	15,800	238,106.00	0.04
466	600816	建元信托	83,500	236,305.00	0.04
467	688063	派能科技	4,133	234,837.06	0.04
468	600258	首旅酒店	14,000	234,500.00	0.04
469	002266	浙富控股	55,900	232,544.00	0.04
470	600004	白云机场	24,300	229,878.00	0.04
471	002701	奥瑞金	38,400	228,480.00	0.04
472	600763	通策医疗	5,681	228,433.01	0.04
473	600754	锦江酒店	9,000	227,430.00	0.04
474	000998	隆平高科	24,100	225,576.00	0.04
475	000032	深桑达 A	11,600	224,460.00	0.04
476	601966	玲珑轮胎	15,400	223,762.00	0.04
477	603833	欧派家居	4,200	218,778.00	0.04
478	000069	华侨城 A	85,400	211,792.00	0.03
479	300457	赢合科技	7,500	208,875.00	0.03
480	601866	中远海发	82,700	208,404.00	0.03
481	600655	豫园股份	40,400	207,252.00	0.03
482	600511	国药股份	7,200	207,000.00	0.03
483	300601	康泰生物	14,000	206,780.00	0.03
484	000818	航锦科技	10,700	206,510.00	0.03
485	002120	韵达股份	30,500	205,570.00	0.03
486	600867	通化东宝	24,100	196,897.00	0.03
487	000035	中国天楹	35,624	196,644.48	0.03
488	600325	华发股份	46,400	195,808.00	0.03
489	000967	盈峰环境	26,200	192,308.00	0.03
490	002091	江苏国泰	21,100	190,533.00	0.03
491	603899	晨光股份	7,000	189,420.00	0.03
492	300529	健帆生物	9,500	186,865.00	0.03
493	300070	碧水源	45,700	179,144.00	0.03
494	600864	哈投股份	25,800	171,054.00	0.03
495	002292	奥飞娱乐	19,000	168,150.00	0.03
496	002572	索菲亚	11,800	160,598.00	0.03
497	002891	中宠股份	1,900	98,344.00	0.02
498	001914	招商积余	8,200	87,576.00	0.01

499	600007	中国国贸	3,100	61,442.00	0.01
-----	--------	------	-------	-----------	------

8.3.2 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	688795	摩尔线程	2,560	1,065,011.20	0.17
2	688802	沐曦股份	1,764	704,541.60	0.11
3	688759	必贝特	12,552	315,431.76	0.05
4	688790	昂瑞微	1,913	223,954.91	0.04
5	301656	联合动力	4,382	111,565.72	0.02
6	001280	中国铀业	2,277	103,284.72	0.02
7	688729	屹唐股份	3,505	85,101.40	0.01
8	688809	强一股份	184	37,409.04	0.01
9	301638	南网数字	2,322	32,995.62	0.01
10	001386	马可波罗	1,626	30,129.78	0.00
11	001233	海安集团	370	19,195.60	0.00
12	688796	百奥赛图	423	17,871.75	0.00
13	688807	优迅股份	131	17,758.36	0.00
14	301632	广东建科	656	15,534.08	0.00
15	301563	云汉芯城	110	14,705.90	0.00
16	301491	汉桑科技	245	13,501.95	0.00
17	301584	建发致新	447	11,988.54	0.00
18	001369	双欣环保	897	11,562.33	0.00
19	301609	山大电力	277	11,354.23	0.00
20	301687	新广益	195	10,606.05	0.00
21	001221	悍高集团	160	9,110.40	0.00
22	301667	纳百川	151	8,617.57	0.00
23	603418	友升股份	139	8,209.34	0.00
24	603175	超颖电子	169	8,206.64	0.00
25	603092	德力佳	146	8,126.36	0.00
26	001285	瑞立科密	137	7,682.96	0.00
27	301668	昊创瑞通	165	7,392.00	0.00
28	301449	天溯计量	112	7,305.76	0.00
29	601026	道生天合	451	6,440.28	0.00
30	301575	艾芬达	126	6,243.30	0.00
31	603406	天富龙	153	6,144.48	0.00
32	603262	技源集团	155	4,355.50	0.00
33	603248	锡华科技	260	4,238.00	0.00
34	001388	信通电子	94	4,036.36	0.00
35	603370	华新精科	82	3,800.70	0.00
36	603376	大明电子	111	2,909.31	0.00
37	603334	丰倍生物	88	2,888.16	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	65,682,347.80	3.29
2	000333	美的集团	30,581,953.00	1.53
3	000858	五粮液	24,410,913.00	1.22
4	300059	东方财富	22,914,227.00	1.15
5	002594	比亚迪	17,739,936.00	0.89
6	002475	立讯精密	16,214,198.05	0.81
7	000651	格力电器	15,358,070.33	0.77
8	600519	贵州茅台	13,815,728.00	0.69
9	000725	京东方 A	12,114,630.00	0.61
10	300124	汇川技术	12,071,073.00	0.60
11	300308	中际旭创	11,127,254.08	0.56
12	002714	牧原股份	9,666,087.41	0.48
13	002920	德赛西威	9,585,442.21	0.48
14	300274	阳光电源	9,214,910.15	0.46
15	000063	中兴通讯	8,833,684.00	0.44
16	000001	平安银行	8,501,031.00	0.43
17	000661	长春高新	8,359,741.47	0.42
18	300394	天孚通信	8,312,037.20	0.42
19	002415	海康威视	8,284,713.00	0.42
20	300502	新易盛	8,044,716.00	0.40

注：买入金额不包括相关交易费用。

8.4.2 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	300750	宁德时代	113,768,867.13	5.70
2	000333	美的集团	53,557,945.03	2.68
3	300059	东方财富	42,550,601.31	2.13
4	000858	五粮液	40,398,716.14	2.02
5	002594	比亚迪	39,790,506.77	1.99
6	002475	立讯精密	30,167,044.00	1.51
7	000651	格力电器	28,165,103.00	1.41
8	300124	汇川技术	22,632,662.52	1.13
9	000725	京东方 A	22,139,332.00	1.11
10	300308	中际旭创	20,128,258.00	1.01
11	300502	新易盛	19,029,954.42	0.95
12	002714	牧原股份	17,583,006.40	0.88

13	300274	阳光电源	16,990,762.52	0.85
14	000063	中兴通讯	16,290,502.94	0.82
15	000001	平安银行	16,119,326.00	0.81
16	002415	海康威视	15,937,958.50	0.80
17	002352	顺丰控股	14,076,615.00	0.71
18	002230	科大讯飞	13,262,950.00	0.66
19	000568	泸州老窖	13,118,559.28	0.66
20	000100	TCL 科技	12,568,154.00	0.63

注：卖出金额不包括相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,010,492,380.86
卖出股票收入（成交）总额	1,697,848,580.48

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

华宝中证 A500ETF 截止 2025 年 12 月 31 日持仓前十名证券的发行主体中, 兴业银行股份有限公司因未依法履行其他职责; 于 2025 年 07 月 11 日收到中国银行间市场交易商协会立案调查的处罚措施。

华宝中证 A500ETF 截止 2025 年 12 月 31 日持仓前十名证券的发行主体中, 招商银行股份有限公司因内部制度不完善; 于 2025 年 09 月 12 日收到金融监管总局警告, 罚款的处罚措施。

华宝中证 A500ETF 截止 2025 年 12 月 31 日持仓前十名证券的发行主体中, 兴业银行股份有限公司因外包机构管理不到位、企业划型不准确等; 于 2025 年 12 月 05 日收到金融监管总局罚款的处罚措施。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和分析, 认为上述处分不会对公司的投资价值构成实质性影响, 因此本基金管理人对上述证券的投资判断未发生改变。报告期内, 本基金投资的前十名证券的其余的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

本基金本报告期末未持有其他资产。

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 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。

8.12.5.2 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	1,065,011.20	0.17	新股锁定
2	688802	沐曦股份	704,541.60	0.11	新股锁定
3	688759	必贝特	315,431.76	0.05	新股锁定
4	688790	昂瑞微	223,954.91	0.04	新股锁定

5	301656	联合动力	111,565.72	0.02	新股锁定
---	--------	------	------------	------	------

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

9.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
1,083	917,782.74	937,881,474.00	94.36	56,077,238.00	5.64

9.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
兴业银行股份有限公司 - 华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	419,399,500.00	42.19

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	长江养老保险股份有限公司-中国太平洋人寿权益基金型投资产品(个分红)委托专户	111,691,370.00	11.24
2	长江养老保险股份有限公司-中国太平洋人寿权益基金型投资产品(保额分红)委托专户	111,691,370.00	11.24
3	长江养老保险股份有限公司-中国太平洋人寿权益基金型投资产品(寿自营)委托专户	111,691,370.00	11.24
4	中信建投证券股份有限公司	64,042,636.00	6.44

5	华宝证券—华宝投资有限公司—华宝证券华正 6 号单一资产管理计划	60,092,100.00	6.05
6	BARCLAYS BANK PLC	8,976,778.00	0.90
7	联储证券股份有限公司	8,342,200.00	0.84
8	中国人寿再保险有限责任公司	7,710,438.00	0.78
9	国泰海通证券股份有限公司	5,855,302.00	0.59
10	兴银理财有限责任公司—兴银理财睿利兴成锦鑫日开 1 号增强型固收类理财产品	4,039,732.00	0.41
11	兴业银行股份有限公司—华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	419,399,500.00	42.19

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	0.00	0.0000

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2024 年 11 月 22 日)基金份额总额	1,999,979,356.00
本报告期期初基金份额总额	1,972,979,356.00
本报告期基金总申购份额	1,710,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	3,324,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	634,979,356.00
本报告期期末基金份额总额	993,958,712.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

2025 年 1 月 9 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，聘任吕笑然为公司副总经理。

2025 年 6 月 27 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，吕笑然不再担任公司副总经理。

2025 年 8 月 22 日，基金管理人发布董事长变更公告，夏雪松担任公司董事长，黄孔威不再担任公司董事长。

2025 年 9 月 8 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，聘任夏英为公司常务副总经理。

2025 年 10 月 24 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，聘任欧江洪为公司副总经理。

报告期内托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 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管理业务、基金财产和基金托管业务的诉讼事项。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自 2025 年 11 月 11 日起更换会计师事务所，由安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)更换为容诚会计师事务所(特殊普通合伙)。基金管理人为本基金聘任的会计师事务所在本报告期的审计报酬为 22,568.00 元人民币。目前该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。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人无相关情况。

11.6.2 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相关情况。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人相关从业人员在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用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	5	2,698,591,501.55	100.00	501,752.66	100.00	-

注：1、基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

(1) 选择标准: 资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需，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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期内未租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2025-01-22
2	华宝基金关于旗下部分交易型开放式指数证券投资基金新增民生证券股份有限公司为一级交易商的公告	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	2025-04-09

3	华宝基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法调整的公告	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	2025-04-22
4	华宝基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2025-04-22
5	华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2025-04-22
6	华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金第一次分红公告	基金管理人网站, 中国证券报	2025-05-15
7	华宝基金关于旗下部分交易型开放式指数证券投资基金新增万和证券股份有限公司为一级交易商的公告	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	2025-06-10
8	华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 2 季度报告	基金管理人网站	2025-07-21
9	华宝基金关于旗下部分交易型开放式指数证券投资基金新增金元证券股份有限公司为一级交易商的公告	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	2025-08-12
10	华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金第二次分红公告	基金管理人网站, 中国证券报	2025-08-12
11	华宝基金关于旗下部分交易型开放式指数证券投资基金新增东方财富证券股份有限公司为一级交易商的公告	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	2025-08-20
12	华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年中期报告	基金管理人网站	2025-08-29
13	华宝基金关于旗下部分交易型开放式指数证券投资基金新增华鑫证券有限责任公司为一级交易商的公告	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	2025-09-15
14	华宝基金关于旗下部分交易型开放式指数证券投资基金新增甬兴证券有限公司为一级交易商的公告	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	2025-09-15
15	华宝基金管理有限公司关于华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金实施基金份额拆分并调整最小申购、赎回单位及相关业务安排的公告	基金管理人网站, 中国证券报	2025-10-14
16	华宝基金管理有限公司关于华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金份额拆分结果的公告	基金管理人网站, 中国证券报	2025-10-20
17	华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 3 季度报告	基金管理人网站	2025-10-28
18	华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金第三次分红公告	基金管理人网站, 中国证券报	2025-11-12
19	华宝基金管理有限公司关于旗下基	基金管理人网站	2025-11-13

	金改聘会计师事务所公告		
20	华宝基金管理有限公司关于旗下部分上交所 ETF 申购赎回清单版本更新的公告	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	2025-11-17
21	华宝基金关于旗下部分交易型开放式指数证券投资基金新增瑞银证券有限责任公司为一级交易商的公告	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	2025-11-18
22	华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书 (更新)	基金管理人网站	2025-11-18
23	华宝基金管理有限公司关于旗下部分基金增加流动性服务商的公告	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	2025-11-24
24	华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要 (更新)	基金管理人网站	2025-12-12
25	华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书 (更新)	基金管理人网站	2025-12-12
26	华宝基金管理有限公司关于旗下部分 ETF 变更扩位证券简称的公告	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	2025-12-19
27	华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要 (更新)	基金管理人网站	2025-12-19

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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 (%)
兴业银行股份有限公司-华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	20250121~20251231	0.00	1,202,784,200.00	783,384,700.00	419,399,500.00	42.19
产品特有风险							
<p>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。</p> <p>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</p>							

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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；
华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同；
华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书；
华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议；
基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；
基金托管人业务资格批件和营业执照。

13.2 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。

13.3 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 3 月 31 日