

华宝中证全指农牧渔交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(原华宝中证全指农牧渔指数型发起式证券投资基金)
2025年第4季度报告

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：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：2026年1月22日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 01 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 10 月 10 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况（转型后）

基金简称	华宝中证全指农牧渔 ETF 发起式联接
基金主代码	013471
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2025 年 10 月 10 日
报告期末基金份额总额	130,134,673.70 份
投资目标	本基金主要通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为 ETF 联接基金，主要通过投资于目标 ETF 实现对标的指数的紧密跟踪。本基金力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。本基金对于标的指数成份股和备选成份股部分的投资，采用被动式指数化投资的方法进行日常管理，但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的个券时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，包括通过投资其他股票进行替代，以降低跟踪误差，优化投资组合的配置结构。

业绩比较基准	中证全指农牧渔指数收益率 \times 95% + 人民币银行活期存款利率（税后） \times 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预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，并且具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。	
基金管理人	华宝基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华宝中证全指农牧渔 ETF 发起式联接 A	华宝中证全指农牧渔 ETF 发起式联接 C
下属分级基金的交易代码	013471	013472
报告期末下属分级基金的份额总额	42,150,973.12 份	87,983,700.58 份

2.1.1 目标基金基本情况（转型后）

基金名称	华宝中证全指农牧渔交易型开放式指数证券投资基金	
基金主代码	159275	
基金运作方式	交易型开放式	
基金合同生效日	2025 年 9 月 19 日	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2025 年 9 月 29 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	上海浦东发展银行股份有限公司	

2.1.2 目标基金产品说明（转型后）

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	中证全指农牧渔指数收益率
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。

2.1 基金基本情况（转型前）

基金简称	华宝中证全指农牧渔指数发起式
------	----------------

基金主代码	013471	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 12 月 6 日	
报告期末基金份额总额	132,542,228.80 份	
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	本基金力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。本基金对于标的指数成份股和备选成份股部分的投资，采用被动式指数化投资的方法进行日常管理，但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的个券时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，包括通过投资其他股票进行替代，以降低跟踪误差，优化投资组合的配置结构。	
业绩比较基准	中证全指农牧渔指数收益率 \times 95% + 人民币银行活期存款利率（税后） \times 5%	
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。	
基金管理人	华宝基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华宝中证全指农牧渔指数发起式 A	华宝中证全指农牧渔指数发起式 C
下属分级基金的交易代码	013471	013472
报告期末下属分级基金的份额总额	37,695,578.26 份	94,846,650.54 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2025 年 10 月 10 日 – 2025 年 12 月 31 日)	
	华宝中证全指农牧渔 ETF 发起式联接 A	华宝中证全指农牧渔 ETF 发起式联接 C
1. 本期已实现收益	1,241,630.26	3,072,706.33
2. 本期利润	-528,970.80	-1,089,378.26
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0130	-0.0116
4. 期末基金资产净值	34,325,481.23	70,787,469.66
5. 期末基金份额净值	0.8143	0.8046

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. 本基金合同在当期生效。

3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2025 年 10 月 1 日 – 2025 年 10 月 9 日)	
	华宝中证全指农牧渔指数发起式 A	华宝中证全指农牧渔指数发起式 C
1. 本期已实现收益	-5,183.31	-18,439.61
2. 本期利润	51,747.88	123,180.98
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0014	0.0013
4. 期末基金资产净值	31,180,991.24	77,564,423.78
5. 期末基金份额净值	0.8272	0.8178

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。

3.2 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

华宝中证全指农牧渔 ETF 发起式联接 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标	业绩比较基准	业绩比较基准	①-③	②-④

		准差②	收益率③	收益率标准差 ④		
过去三个月	-	-	-	-	-	-
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同 生效起至今	-1.56%	0.74%	-2.49%	0.76%	0.93%	-0.02%

华宝中证全指农牧渔 ETF 发起式联接 C

阶段	净值增长率①	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	-	-	-	-	-	-
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同 生效起至今	-1.61%	0.73%	-2.49%	0.76%	0.88%	-0.03%

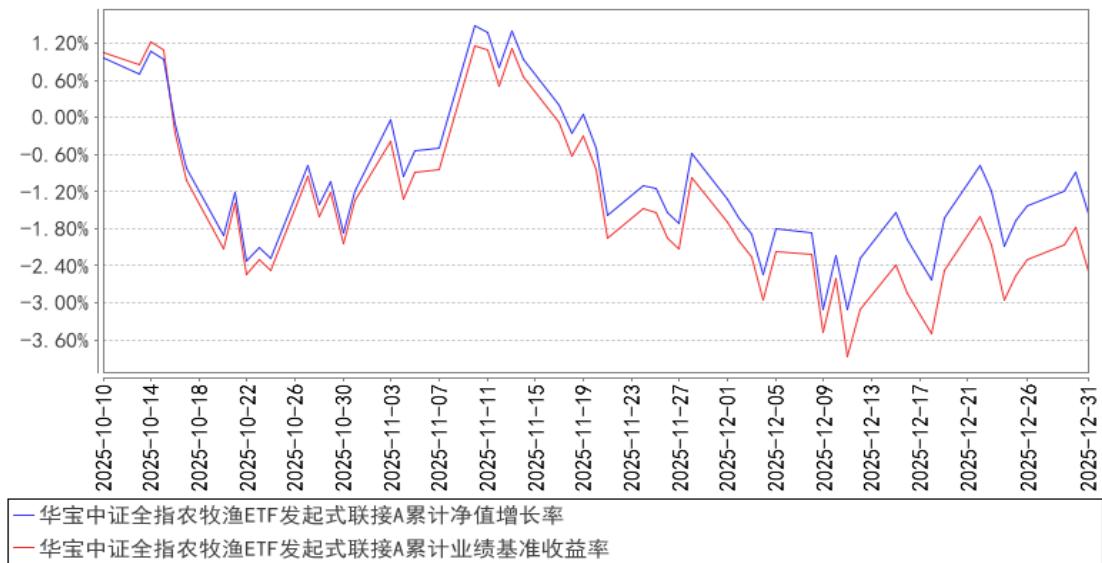
注: (1) 本基金自 2025 年 10 月 10 日起, 由华宝中证全指农牧渔指数型发起式证券投资基金转型而来, 截止报告日本基金基金合同自转型之日起生效未满一年;

(2) 基金业绩基准: 中证全指农牧渔指数收益率 \times 95% + 人民币银行活期存款利率 (税后) \times 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累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华宝中证全指农牧渔 ETF 发起式联接 A 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



华宝中证全指农牧渔 ETF 发起式联接 C 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按照基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定，截至本报告期末，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

华宝中证全指农牧渔指数发起式 A

阶段	净值增长率①	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	6.24%	1.02%	6.32%	1.03%	-0.08%	-0.01%
过去六个月	5.44%	0.96%	4.47%	0.97%	0.97%	-0.01%
过去一年	13.47%	1.18%	13.83%	1.21%	-0.36%	-0.03%
过去三年	-10.72%	1.26%	-11.56%	1.27%	0.84%	-0.01%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同 生效日起至 今	-17.28%	1.39%	-16.93%	1.40%	-0.35%	-0.01%

华宝中证全指农牧渔指数发起式 C

阶段	净值增长率①	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	6.17%	1.02%	6.32%	1.03%	-0.15%	-0.01%
过去六个月	5.28%	0.96%	4.47%	0.97%	0.81%	-0.01%
过去一年	13.13%	1.18%	13.83%	1.21%	-0.70%	-0.03%
过去三年	-11.52%	1.26%	-11.56%	1.27%	0.04%	-0.01%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同 生效日起至 今	-18.22%	1.39%	-16.93%	1.40%	-1.29%	-0.01%

注: (1) 本基金成立于 2021 年 12 月 06 日。

(2) 基金业绩基准: 中证全指农牧渔指数收益率 \times 95% + 人民币银行活期存款利率 (税后) \times 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 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华宝中证全指农牧渔指数发起式A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



华宝中证全指农牧渔指数发起式C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金于 2025 年 10 月 10 日转型。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈建华	本基金基金经理	2025-10-10	-	25 年	硕士。曾在南方证券上海分公司工作。2007 年 8 月加入华宝基金管理有限公司，先后在研究部、量化投资部任助理分析师、数量分析师、基金经理助理等职务。2012 年 12 月至 2022 年 10 月任华宝中证 100 指数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，2017 年 5 月至 2021 年 1 月任华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金、华宝智慧产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 7 月至 2019 年 3 月任华宝新优享灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 2 月起任华宝中证细分化工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 月起任华宝中证金融科技主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 3 月起任华宝中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 4 月起任华宝中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 6 月起任华宝中证智能电动汽车交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 6 月起任华宝中证细分化工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 10 月至 2024 年 10 月任华宝中证新材料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 11 月起任华宝中证智能电动汽车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 11 月起任华宝中证金融科技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 12 月至 2025 年 10 月任华宝中证全指农牧渔指数型发起式证券投资基金基金经理，2022 年 7 月起任华宝中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2022 年 10 月起任华宝中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2022 年 12 月起任华宝中证有色金属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 8 月起任华宝上证科创板芯片指数型发起式证券投资基金基金经理，2024 年 12 月起任华宝创业板人工智能交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 2 月起任华宝创业板人工智能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，2025 年 9 月起任华宝中证全指农牧渔交易型开放式指数证券投资基金基
--	--	--	--	--

					金经理, 2025 年 10 月起任华宝中证全指农牧渔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, 2025 年 12 月起任华宝中证港股通汽车产业主题交易型开放式指数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。

4.1.1 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 基金经理 (或基金经理小组) 简介 (转型前)

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈建华	本基金基金经理	2021-12-06	2025-10-09	25 年	硕士。曾在南方证券上海分公司工作。2007 年 8 月加入华宝基金管理有限公司, 先后在研究部、量化投资部任助理分析师、数量分析师、基金经理助理等职务。2012 年 12 月至 2022 年 10 月任华宝中证 100 指数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, 2017 年 5 月至 2021 年 1 月任华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金、华宝智慧产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2017 年 7 月至 2019 年 3 月任华宝新优享灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2021 年 2 月起任华宝中证细分化工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 月起任华宝中证金融科技主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2021 年 3 月起任华宝中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2021 年 4 月起任华宝中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2021 年 6 月起任华宝中证智能电动汽车交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2021 年 6 月起任华宝中证细分化工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 10 月至 2024 年 10 月任华

				宝中证新材料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 11 月起任华宝中证智能电动汽车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 11 月起任华宝中证金融科技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 12 月至 2025 年 10 月任华宝中证全指农牧渔指数型发起式证券投资基金基金经理，2022 年 7 月起任华宝中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2022 年 10 月起任华宝中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2022 年 12 月起任华宝中证有色金属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 8 月起任华宝上证科创板芯片指数型发起式证券投资基金基金经理，2024 年 12 月起任华宝创业板人工智能交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 2 月起任华宝创业板人工智能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，2025 年 9 月起任华宝中证全指农牧渔交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 10 月起任华宝中证全指农牧渔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，2025 年 12 月起任华宝中证港股通汽车产业主题交易型开放式指数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。

4.1.1 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、《华宝中证全指农牧渔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 公平交易专项说明

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，本基金管理人未发生所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾 2025 年 4 季度，中国宏观经济在“稳增长、防风险、促转型”三线并进中保持温和扩张。虽然外部环境复杂多变，但国内产业韧性较强，尤其是人工智能、高端制造等新质生产力领域加速突破，为经济注入新动能。12 月召开的中央经济工作会议，明确了“十五五”开局年的政策基调，强调“内需主导”与“创新驱动”作为经济发展的双支柱。财政与货币政策将保持支持力度。财政政策强调“更加积极”，保持必要财政赤字和债务规模，超长期特别国债和专项债规模或小幅扩容。货币政策维持“适度宽松”基调，但更强调灵活高效运用。内需方面，服务消费成为提质增效的关键方向，可通过优化供给、释放消费潜力等方式增强动能。海外方面，美联储在 10 月及 12 月降息两次，全球流动性维持宽松。展望后续，2026 年作为“十五五”开局年，经济工作将更注重供需动态平衡，强调结构优化与新质生产力驱动。市场方面，A 股整体表现稳健，但不同板块表现差异明显。2025 年 4 季度，有色金属、石油石化、通信等行业表现较好，医药生物、房地产、计算机等行业表现较弱。指数方面，市场上基准指数呈现分化，以中证 A100 指数和沪深 300 指数为代表的大盘蓝筹股指数，分别下跌了 0.23% 和 0.23%，而作为中小盘代表的中证 500 指数和中证 1000 指数，分别上涨了 0.72% 与 0.27%。

在本报告期内，中证农牧渔指数下跌 2.45%。

本报告期本基金为正常运作期，在操作中，我们严格遵守基金合同，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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额 A 类净值增长率为-1.56%，本报告期基金份额 C 类净值增长率为-1.61%；同期业绩比较基准收益率为-2.49%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告（转型后）

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,889.36	0.00
	其中：股票	1,889.36	0.00
2	基金投资	99,178,330.10	91.79
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	7,104,143.91	6.58
8	其他资产	1,759,693.70	1.63
9	合计	108,044,057.07	100.00

注：本基金本报告期末“固定收益投资”、“买入返售金融资产”、“银行存款和结算备付金合计”等项目的列报金额已包含对应的“应计利息”和“减值准备”（若有），“其他资产”中的“应收利息”指本基金截至本报告期末已过付息期但尚未收到的利息金额（下同）。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,889.36	0.00
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	1,889.36	0.00

5.2.2 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。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	001388	信通电子	44	1,889.36	0.00

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告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

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	华宝中证全指农牧渔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	99,178,330.10	94.35

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未投资股指期货。

5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

5.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

5.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1 本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。

5.12.2 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。

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	68,319.39
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	1,691,374.31
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,759,693.70

5.12.4 报告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。

5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	001388	信通电子	1,889.36	0.00	新股锁定

5.12.6 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。

§ 5 投资组合报告（转型前）

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	102,970,368.95	91.65
	其中：股票	102,970,368.95	91.65
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	7,219,306.96	6.43
8	其他资产	2,158,557.53	1.92
9	合计	112,348,233.44	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）。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	54,211,282.09	49.85
B	采矿业	-	-

C	制造业	47,792,389.47	43.95
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	939,960.00	0.86
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	102,943,631.56	94.66

5.2.2 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	-	-
C	制造业	26,737.39	0.02
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	26,737.39	0.02
----	-----------	------

5.2.3 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。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

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	002714	牧原股份	334,977	17,703,534.45	16.28
2	300498	温氏股份	820,720	15,429,536.00	14.19
3	002311	海大集团	163,900	10,325,700.00	9.50
4	000876	新希望	445,720	4,417,085.20	4.06
5	600873	梅花生物	393,300	4,259,439.00	3.92
6	002385	大北农	677,600	2,784,936.00	2.56
7	002299	圣农发展	122,473	2,166,547.37	1.99
8	600201	生物股份	220,700	2,147,411.00	1.97
9	600598	北大荒	140,100	2,030,049.00	1.87
10	000998	隆平高科	202,600	1,975,350.00	1.82

5.3.2 报告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前五名股票投资明细

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	301678	新恒汇	149	11,361.25	0.01
2	301590	优优绿能	25	5,278.00	0.00
3	301595	太力科技	86	3,295.52	0.00
4	301636	泽润新能	46	2,593.48	0.00
5	001390	古麒绒材	93	2,211.54	0.00

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	67,852.00
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	2,090,705.53
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	2,158,557.53

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告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。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	301678	新恒汇	11,361.25	0.01	新股锁定
2	301590	优优绿能	5,278.00	0.00	新股锁定
3	301595	太力科技	3,295.52	0.00	新股锁定
4	301636	泽润新能	2,593.48	0.00	新股锁定
5	001390	古麒绒材	2,211.54	0.00	新股锁定

5.11.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

项目	华宝中证全指农牧渔 ETF 发起式联接 A	华宝中证全指农牧渔 ETF 发起式联接 C
基金合同生效日(2025 年 10 月 10 日)基 金份额总额	37,695,578.26	94,846,650.54
基金合同生效日起至报告期期末基金总 申购份额	15,252,027.21	98,861,985.89
减：基金合同生效日起至报告期期末基 金总赎回份额	10,796,632.35	105,724,935.85
基金合同生效日起至报告期期末基金拆 分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	42,150,973.12	87,983,700.58

注：本基金合同生效日于 2025 年 10 月 10 日。

§ 6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

项目	华宝中证全指农牧渔指数 发起式 A	华宝中证全指农牧渔指数 发起式 C
报告期期初基金份额总额	37,857,394.21	94,103,980.04
报告期期间基金总申购份额	162,367.08	2,371,562.32
减：报告期期间基金总赎回份额	324,183.03	1,628,891.82
报告期期间基金拆分变动份额(份额减	-	-

少以“-”填列)		
报告期期末基金份额总额	37,695,578.26	94,846,650.54

注：本基金合同生效日于 2021 年 12 月 06 日。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	华宝中证全指农牧渔 ETF 发起式联接 A	华宝中证全指农牧渔 ETF 发起式联接 C
基金合同生效日(2025 年 10 月 10 日)管理人持有的本基金份额	9,900,000.00	100,000.00
基金合同生效日起至报告期期末买入/申购总份额	0.00	0.00
基金合同生效日起至报告期期末卖出/赎回总份额	0.00	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	9,900,000.00	100,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	23.49	0.11

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	华宝中证全指农牧渔指数发起式 A	华宝中证全指农牧渔指数发起式 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	9,900,000.00	100,000.00
报告期期间买入/申购总份额	0.00	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	9,900,000.00	100,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	26.26	0.11

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况（转型后）

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限

基金管理人固有资金	10,000,000.00	7.68	10,000,000.00	7.68	不少于三年
基金管理人高级管理人员	—	—	—	—	—
基金经理等人员	—	—	—	—	—
基金管理人股东	—	—	—	—	—
其他	—	—	—	—	—
合计	10,000,000.00	7.68	10,000,000.00	7.68	—

注：本基金募集期间，本基金管理人运用固有资金作为发起资金总计 10,001,000.00 元认购了本基金。发起资金认购的基金份额自基金合同生效之日起持有期不少于三年，符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定。

§ 8 报告期末发起式基金发起资产持有份额情况（转型前）

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	7.54	10,000,000.00	7.54	—
基金管理人高级管理人员	—	—	—	—	—
基金经理等人员	—	—	—	—	—
基金管理人股东	—	—	—	—	—
其他	—	—	—	—	—
合计	10,000,000.00	7.54	10,000,000.00	7.54	—

注：本基金募集期间，本基金管理人运用固有资金作为发起资金总计 10,001,000.00 元认购了本基金。发起资金认购的基金份额自基金合同生效之日起持有期不少于三年，符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定。

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

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。

基金管理人于 2025 年 10 月 09 日发布关于华宝中证全指农牧渔指数型发起式证券投资基金变更为华宝中证全指农牧渔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。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；
华宝中证全指农牧渔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；
华宝中证全指农牧渔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；
华宝中证全指农牧渔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。

10.2 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。

10.3 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 1 月 22 日