

华宝沪深 300 增强策略交易型开放式指数  
证券投资基金发起式联接基金(原华宝沪  
深 300 指数增强型发起式证券投资基金)  
2026 年第 1 季度报告

2026 年 3 月 31 日

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 4 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 04 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 2026 年 01 月 09 日（基金合同生效日）起至 03 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	华宝沪深 300 增强策略 ETF 发起式联接
基金主代码	003876
基金运作方式	契约型开放式、发起式
基金合同生效日	2026 年 1 月 9 日
报告期末基金份额总额	460,198,183.34 份
投资目标	本基金主要通过投资于目标 ETF，在力求有效跟踪标的指数基础上，力争获取超越指数表现的投资收益。
投资策略	本基金主要投资于目标 ETF。本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%。同时，基于流动性管理及策略性投资的需要，本基金也会在控制风险前提下适度投资于债券、股指期货、货币市场工具及其他金融工具。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+人民币银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为 ETF 联接基金，目标 ETF 为股票型指数基金，本基金的预期风险与收益理论上高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

基金管理人	华宝基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华宝沪深 300 增强策略 ETF 发起式联接 A	华宝沪深 300 增强策略 ETF 发起式联接 C
下属分级基金的交易代码	003876	007404
报告期末下属分级基金的份额总额	435,981,875.71 份	24,216,307.63 份

### 2.1.1 目标基金基本情况（转型后）

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

### 2.1.2 目标基金产品说明（转型后）

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

### 2.1 基金基本情况（转型前）

基金简称	华宝沪深 300 增强
基金主代码	003876
基金运作方式	契约型开放式、发起式
基金合同生效日	2016 年 12 月 9 日
报告期末基金份额总额	1,122,845,309.04 份

投资目标	本基金为沪深 300 指数增强型基金，在实现对沪深 300 指数有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的组合配置和管理，力争实现稳定的优于标的指数的投资收益，追求基金资产的长期增值。	
投资策略	本基金主要投资于沪深 300 指数成分股及备选股票。本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于沪深 300 指数成分股及备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%。同时，基于流动性管理及策略性投资的需要，本基金也会在控制风险前提下适度投资于债券、股指期货、货币市场工具及其他金融工具。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*95%+1.5%	
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于高预期风险、高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。	
基金管理人	华宝基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华宝沪深 300 增强 A	华宝沪深 300 增强 C
下属分级基金的交易代码	003876	007404
报告期末下属分级基金的份额总额	974,300,564.88 份	148,544,744.16 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（2026 年 1 月 9 日 - 2026 年 3 月 31 日）	
	华宝沪深 300 增强策略 ETF 发起式联接 A	华宝沪深 300 增强策略 ETF 发起式联接 C
1. 本期已实现收益	108,464,064.14	14,829,010.41
2. 本期利润	-30,791,377.48	-1,474,258.43
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0513	-0.0242
4. 期末基金资产净值	595,490,976.33	31,861,414.81
5. 期末基金份额净值	1.3659	1.3157

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（2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 1 月 8 日）	
	华宝沪深 300 增强 A	华宝沪深 300 增强 C
1. 本期已实现收益	-309,775.37	-39,599.00
2. 本期利润	27,063,822.34	4,002,189.09
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0277	0.0329
4. 期末基金资产净值	1,399,219,741.66	205,698,041.73
5. 期末基金份额净值	1.4361	1.3848

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

华宝沪深 300 增强策略 ETF 发起式联接 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	-	-	-	-	-	-
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同	-4.89%	0.83%	-5.76%	0.89%	0.87%	-0.06%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

华宝沪深 300 增强策略 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	-4.99%	0.83%	-5.76%	0.89%	0.77%	-0.06%

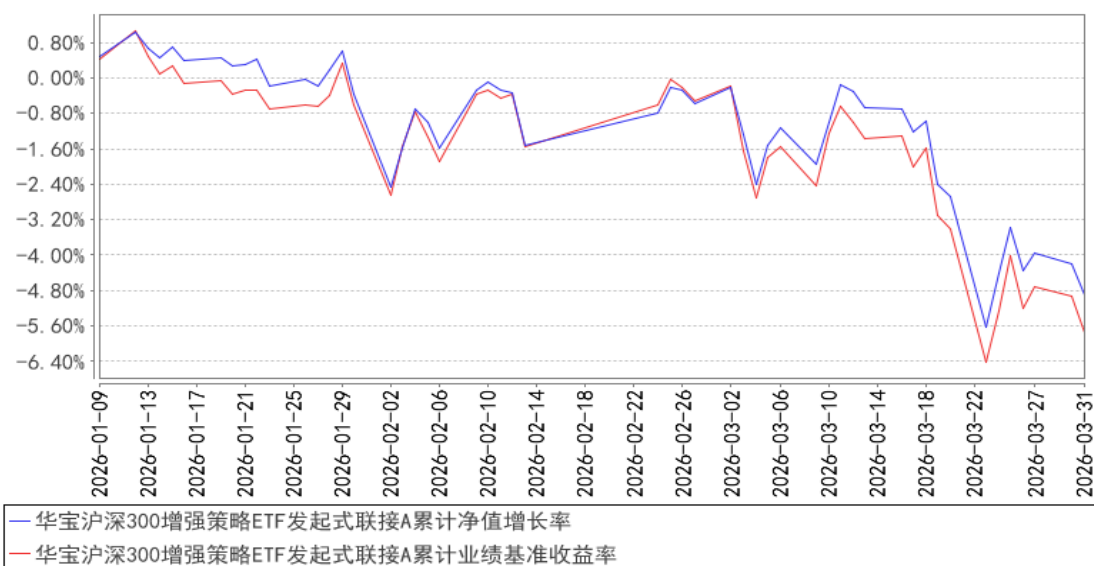
注：（1）本基金自 2026 年 1 月 9 日起，由华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金转型而来，截止报告日本基金基金合同自转型之日起生效未满一年；

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

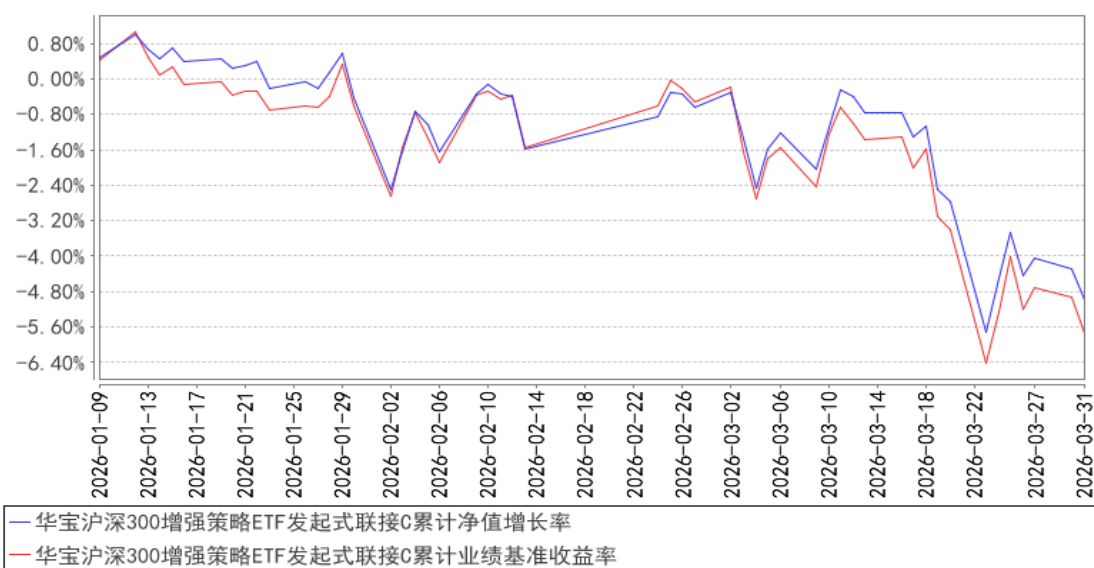
（3）净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

### 3.2.2 自基金转型以来基金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

**华宝沪深300增强策略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**



**华宝沪深300增强策略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：1、本基金基金合同生效于 2026 年 01 月 09 日，截止报告日本基金基金合同生效未满一年。  
2、按照基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期。

### 3.2 基金净值表现（转型前）

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华宝沪深 300 增强 A

阶段	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	①—③	②—④
----	--------	---------------	----------------	----------------	-----	-----

				准差④		
过去三个月	3.11%	0.87%	2.41%	0.93%	0.70%	-0.06%
过去六个月	18.96%	0.84%	18.40%	0.89%	0.56%	-0.05%
过去一年	26.96%	0.87%	25.56%	0.91%	1.40%	-0.04%
过去三年	27.09%	0.99%	23.62%	1.02%	3.47%	-0.03%
过去五年	-7.04%	1.06%	-6.09%	1.08%	-0.95%	-0.02%
自基金合同 生效日起至 今	108.68%	1.12%	54.99%	1.11%	53.69%	0.01%

华宝沪深 300 增强 C

阶段	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	3.02%	0.87%	2.41%	0.93%	0.61%	-0.06%
过去六个月	18.76%	0.84%	18.40%	0.89%	0.36%	-0.05%
过去一年	26.48%	0.87%	25.56%	0.91%	0.92%	-0.04%
过去三年	25.59%	0.99%	23.62%	1.02%	1.97%	-0.03%
过去五年	-8.86%	1.06%	-6.09%	1.08%	-2.77%	-0.02%
自基金合同 生效日起至 今	72.90%	1.11%	44.25%	1.11%	28.65%	0.00%

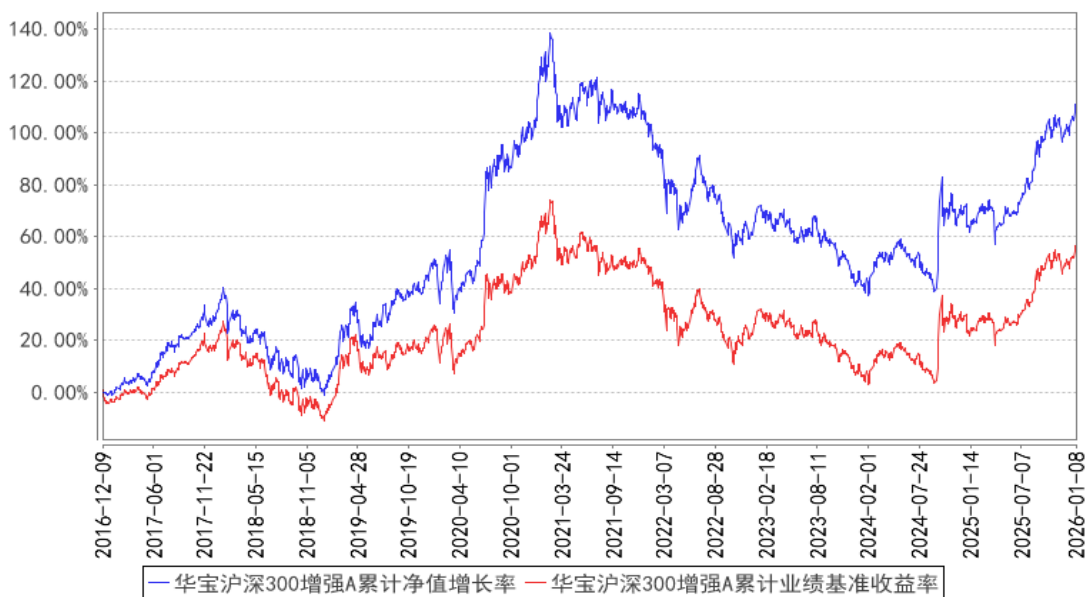
注：（1）本基金成立于 2016 年 12 月 09 日；

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

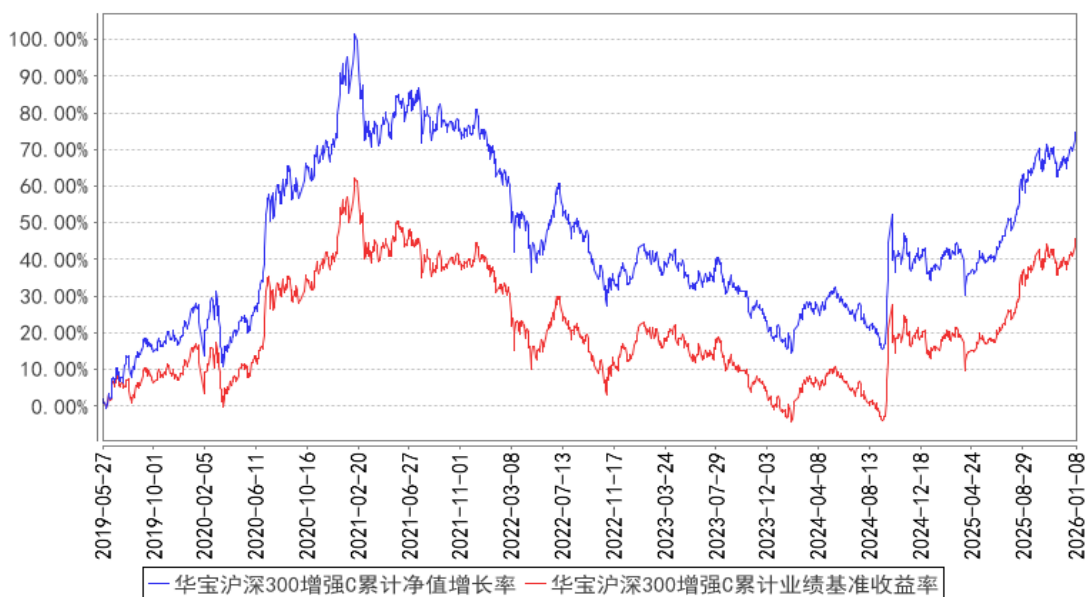
（3）净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

华宝沪深300增强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



华宝沪深300增强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 2026 年 1 月 9 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		
徐林明	本基金基金经理、量化投资总监、量化投资部总经理	2026-01-09	-	24 年	硕士。曾在兴业证券、凯龙财经（上海）有限公司、中原证券从事金融工程研究工作。2005 年 8 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任金融工程部数量分析师、金融工程部副总经理等职务，现任量化投资总监、量化投资部总经

				<p>理。2009 年 9 月至 2015 年 11 月任华宝中证 100 指数证券投资基金基金经理，2010 年 4 月至 2015 年 11 月任上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2014 年 9 月起任华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金基金经理，2015 年 4 月至 2020 年 2 月任华宝事件驱动混合型证券投资基金基金经理，2016 年 12 月至 2026 年 1 月任华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理，2019 年 2 月至 2022 年 10 月任华宝科技先锋混合型证券投资基金基金经理，2021 年 12 月至 2023 年 11 月任华宝中证稀有金属主题指数增强型发起式证券投资基金基金经理，2022 年 8 月至 2023 年 11 月任华宝高端装备股票型发起式证券投资基金基金经理，2023 年 2 月起任华宝量化选股混合型发起式证券投资基金基金经理，2025 年 6 月起任华宝中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理，2025 年 12 月起任华宝沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2026 年 1 月起任华宝沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。</p>
王正	本基金基金经理	2026-01-09	-	<p>14 年</p> <p>硕士。2012 年 7 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任助理量化分析师、分析师、基金经理助理等职务。2020 年 1 月至 2026 年 1 月任华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理，2020 年 1 月起任华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金基金经理，2021 年 1 月至 2022 年 8 月任华宝智慧产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 1 月至 2024 年 7 月任华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 1 月至 2022 年 7 月任华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理，2021 年 6 月至 2023 年 3 月任华宝安盈混合型证券投资基金基金经理，2025 年 8 月起任华宝创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 8 月起任华宝科技</p>

					先锋混合型证券投资基金、华宝中证稀有金属主题指数增强型发起式证券投资基金基金经理，2025 年 12 月起任华宝沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2026 年 1 月起任华宝沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

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。

#### 4.1.1 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		
徐林明	本基金基金经理、量化投资总监、量化投资部总经理	2016-12-09	2026-01-08	24 年	硕士。曾在兴业证券、凯龙财经（上海）有限公司、中原证券从事金融工程研究工作。2005 年 8 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任金融工程部数量分析师、金融工程部副总经理等职务，现任量化投资总监、量化投资部总经理。2009 年 9 月至 2015 年 11 月任华宝中证 100 指数证券投资基金基金经理，2010 年 4 月至 2015 年 11 月任上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2014 年 9 月起任华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金基金经理，2015 年 4 月至 2020 年 2 月任华宝事件驱动混合型证券投资基金基金经理，2016 年 12 月至 2026 年 1 月任华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理，2019 年 2 月至 2022 年 10 月任华宝科技先锋混合型证券投资基金基金经理，2021 年 12 月至 2023 年 11 月任华宝中证稀有金属主题指数增强型发起式证券投资基金基金经理，2022 年 8 月至 2023 年 11 月任华宝高端装备股票型发起式证券投资基

					金基金经理，2023 年 2 月起任华宝量化选股混合型发起式证券投资基金基金经理，2025 年 6 月起任华宝中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理，2025 年 12 月起任华宝沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2026 年 1 月起任华宝沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。
王正	本基金基金经理	2020-01-02	2026-01-08	14 年	硕士。2012 年 7 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任助理量化分析师、分析师、基金经理助理等职务。2020 年 1 月至 2026 年 1 月任华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理，2020 年 1 月起任华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金基金经理，2021 年 1 月至 2022 年 8 月任华宝智慧产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 1 月至 2024 年 7 月任华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 1 月至 2022 年 7 月任华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理，2021 年 6 月至 2023 年 3 月任华宝安盈混合型证券投资基金基金经理，2025 年 8 月起任华宝创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 8 月起任华宝科技先锋混合型证券投资基金、华宝中证稀有金属主题指数增强型发起式证券投资基金基金经理，2025 年 12 月起任华宝沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2026 年 1 月起任华宝沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。

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。

#### 4.1.1 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、《华宝沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 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，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 2 次，系指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内，本基金没有发现异常交易行为。

## 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年一季度，全球宏观呈现地缘冲突主导、滞胀预期升温、资产剧烈分化的核心特征。2 月底中东局势升级引发霍尔木兹海峡航运受阻，全球约 20% 原油供应受阻，国际油价暴涨至百元上方，推升全球通胀粘性，美联储降息预期全面后移，全球金融条件趋紧。全球经济“先扬后抑”，1-2 月延续复苏，3 月受地缘冲击明显放缓。金融市场方面市场开启避险模式，全球股市、信用债普遍承压，主要大类资产波动率大幅抬升，新兴市场资本外流加剧。国内宏观经济展现强韧性，实现“十五五”良好开局。一季度 GDP 预计同比增长 5% 左右，1-2 月规模以上工业增加值增 6.3%，高技术制造业增 13.1%，新质生产力成为核心动能。外贸强势反弹，进出口总额同比增 18.3%；消费稳步回暖，线下消费、服务消费持续修复；货币政策适度宽松，社融增量创历史同期新高。整体看，中国经济在全球不确定性中凸显韧性，政策发力与产业升级为市场提供长

期支撑。

股票市场方面，A 股亦是先扬后抑，一季度波动加剧、风险偏好回落，3 月受海外拖累调整明显。报告期内本基金跟踪的沪深 300 指数累计下跌 3.89%，中证红利上涨 4.07%，创业板指下跌 0.57%，中证 2000 指数上涨 1.22%，整体呈现避险资产和小市值占优的特点。行业层面，煤炭、石油石化、公用事业等防御板块涨幅较高，而非银金融、商贸零售、地产等弱景气度板块走势偏弱。因子层面，行业中性视角下，估值、红利、成长、分析师、质量等主流大类因子都有正常表现，1-2 月成长景气类的因子占优，3 月价值类因子占优，整体 alpha 环境相对友好。

本基金是沪深 300 增强 ETF 的联接基金，主要持有对应的 ETF 份额。沪深 300 增强策略运用量化 Alpha 多因子选股模型进行股票筛选和权重配置，在沪深 300 成分股及备选股内精选业绩和估值相匹配、基本面优质的股票，并严格控制市值、行业等风险暴露，在有限的跟踪误差下力争实现稳定的超越指数的表现。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金自转型以来，基金份额 A 类净值增长率为-4.89%，基金份额 C 类净值增长率为-4.99%；同期业绩比较基准收益率为-5.76%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

### § 5 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	13,936,908.11	2.22
	其中：股票	13,936,908.11	2.22
2	基金投资	558,750,432.90	88.90
3	固定收益投资	35,743,485.42	5.69
	其中：债券	35,743,485.42	5.69
	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	10,000,000.00	1.59
	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	6,422,066.34	1.02
8	其他资产	3,630,926.20	0.58

9	合计	628,483,818.97	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	229,873.23	0.04
C	制造业	9,352,638.14	1.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,500,684.00	0.24
E	建筑业	659,647.00	0.11
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	357,014.00	0.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	649,517.42	0.10
J	金融业	540,897.00	0.09
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	297,159.00	0.05
M	科学研究和技术服务业	349,478.32	0.06
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	13,936,908.11	2.22

### 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	688795	摩尔线程	5,660	2,227,662.80	0.36
2	688802	沐曦股份	3,994	1,653,516.00	0.26

3	688759	必贝特	12,552	411,203.52	0.07
4	000708	中信特钢	18,200	297,388.00	0.05
5	688790	昂瑞微	2,319	235,772.73	0.04
6	600741	华域汽车	9,900	190,179.00	0.03
7	600196	复星医药	6,900	183,747.00	0.03
8	601668	中国建筑	36,300	181,863.00	0.03
9	002028	思源电气	900	181,800.00	0.03
10	000157	中联重科	21,100	181,460.00	0.03

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	35,743,485.42	5.70
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	35,743,485.42	5.70

#### 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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019773	25 国债 08	214,000	21,684,074.74	3.46
2	019792	25 国债 19	60,000	6,045,310.68	0.96
3	102245	国债 2317	20,000	2,035,154.52	0.32
4	102298	国债 2508	20,000	2,026,549.04	0.32
5	102310	国债 2513	20,000	2,019,019.18	0.32

#### 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	华宝沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金	指数基金	交易型开放式	华宝基金管理有限公司	558,750,432.90	89.06

## 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

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IF2606	IF2606	16	21,020,160.00	-592,260.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-592,260.00
股指期货投资本期收益（元）					8,080,884.75
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-9,411,076.47

### 5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

## 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	3,447,848.04
2	应收证券清算款	388.04
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	182,690.12
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	3,630,926.20

### 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	688795	摩尔线程	2,227,662.80	0.36	新股锁定
2	688802	沐曦股份	1,653,516.00	0.26	新股锁定
3	688759	必贝特	411,203.52	0.07	新股锁定
4	688790	昂瑞微	235,772.73	0.04	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	1,397,226,874.32	86.54
	其中：股票	1,397,226,874.32	86.54
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	88,098,154.03	5.46
	其中：债券	88,098,154.03	5.46
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	78,000,000.00	4.83
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

7	银行存款和结算备付金合计	36,524,473.11	2.26
8	其他资产	14,779,620.14	0.92
9	合计	1,614,629,121.60	100.00

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

## 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	5,513,168.00	0.34
B	采矿业	103,450,752.40	6.45
C	制造业	741,187,392.67	46.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	39,454,995.41	2.46
E	建筑业	24,582,434.00	1.53
F	批发和零售业	8,438,587.05	0.53
G	交通运输、仓储和邮政业	39,121,816.00	2.44
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	58,296,497.52	3.63
J	金融业	302,557,863.84	18.85
K	房地产业	5,858,898.00	0.37
L	租赁和商务服务业	18,099,427.14	1.13
M	科学研究和技术服务业	30,968,525.00	1.93
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,377,530,357.03	85.83

### 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	107,861.49	0.01
C	制造业	15,846,878.84	0.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-

F	批发和零售业	1,859,882.06	0.12
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,837,205.04	0.11
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	44,689.86	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	19,696,517.29	1.23

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

#### 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	600096	云天化	83,400	2,893,980.00	0.18
2	000960	锡业股份	87,900	2,757,423.00	0.17
3	688795	摩尔线程	5,660	2,699,480.40	0.17

4	002821	凯莱英	20,000	2,007,200.00	0.13
5	600582	天地科技	323,000	1,905,700.00	0.12

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	88,098,154.03	5.49
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	88,098,154.03	5.49

#### 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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019773	25 国债 08	280,000	28,291,107.94	1.76
2	019766	25 国债 01	254,000	25,689,796.60	1.60
3	102291	国债 2501	99,000	10,012,952.22	0.62
4	019792	25 国债 19	80,000	8,030,012.05	0.50
5	019785	25 国债 13	60,000	6,039,129.86	0.38

#### 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

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IF2601	IF2601	25	35,496,000.00	1,487,426.20	-
IF2603	IF2603	57	80,544,420.00	7,331,390.27	-
公允价值变动总额合计（元）					8,818,816.47
股指期货投资本期收益（元）					-

股指期货投资本期公允价值变动（元）	2,858,700.00
-------------------	--------------

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

## 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 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。

### 5.10.2 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	14,377,482.88
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	402,137.26
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	14,779,620.14

### 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	688795	摩尔线程	2,699,480.40	0.17	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	华宝沪深 300 增强策略 ETF 发起式联接 A	华宝沪深 300 增强策略 ETF 发起式联接 C
基金合同生效日(2026年1月9日)基金份额总额	974,300,564.88	148,544,744.16
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	16,417,935.50	3,671,756.50
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	554,736,624.67	128,000,193.03
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	435,981,875.71	24,216,307.63

注：本基金合同生效日于 2026 年 01 月 09 日。

## § 6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

项目	华宝沪深 300 增强 A	华宝沪深 300 增强 C
报告期期初基金份额总额	976,221,781.17	39,025,091.23
报告期期间基金总申购份额	583,462.04	110,973,525.33
减：报告期期间基金总赎回份额	2,504,678.33	1,453,872.40
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	974,300,564.88	148,544,744.16

注：本基金合同生效日于 2016 年 12 月 09 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

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

### 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

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

### 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）

无

## § 8 报告期末发起式基金发起资产持有份额情况（转型前）

无

## § 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20260130~20260304	109,778,854.02	0.00	27,444,713.51	82,334,140.51	17.89
产品特有风险							
报告期内本基金出现单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况。在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下，如该投资者集中赎回，可能会增加基金的流动性风险。此外，由于基金在遇到大额赎回的时候可能需要变现部分资产，可能对持有资产的价格形成冲击，增加基金的市场风险。基金管理人将专业审慎、勤勉尽责地运作基金资产，加强防范流动性风险、市场风险，保护持有人利益。							

### 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

## § 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；

华宝沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同；

华宝沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金招募说明书；

华宝沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议；

基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；

基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；

基金托管人业务资格批件和营业执照。

## 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 4 月 22 日