

宝盈恒生科技指数型证券投资基金（QDII）

2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：宝盈基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 16 日（基金合同生效日）起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介	11
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	44
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	44

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	45
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	47
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	49
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	49
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	50
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	50
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	50
7.11 投资组合报告附注	50
§8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	51
§9 开放式基金份额变动	52
§10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	53
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	53
10.8 其他重大事件	55
§11 影响投资者决策的其他重要信息	57
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	57
§12 备查文件目录	57
12.1 备查文件目录	57
12.2 存放地点	57
12.3 查阅方式	57

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	宝盈恒生科技指数型证券投资基金（QDII）	
基金简称	宝盈恒生科技指数（QDII）	
基金主代码	026206	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2026 年 1 月 16 日	
基金管理人	宝盈基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	769,631,769.85 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	宝盈恒生科技指数（QDII）A	宝盈恒生科技指数（QDII）C
下属分级基金的交 易代码	026206	026207
报告期末下属分级 基金的份额总额	507,460,089.94 份	262,171,679.91 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动指数化投资，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	本基金主要采用完全复制法跟踪标的指数，即原则上按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。 在正常市场情况下，力争控制本基金的份额净值增长率与业绩比较基准收益率之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 本基金的投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略、衍生品投资策略、境外市场公募基金投资策略、债券投资策略、可转换债券（含可交换债券）投资策略、资产支持证券投资策略、存托凭证投资策略、融资和转融通证券出借、境外回购交易及证券借贷交易策略等。
业绩比较基准	恒生科技指数收益率（使用估值汇率调整）×95%+商业银行人民币活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，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。 本基金投资于境外证券，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

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		宝盈基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张磊	方圆
	联系电话	0755-83276688	95559
	电子邮箱	zhangl@byfunds.com	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		400-8888-300	95559
传真		0755-83515599	021-62701216
注册地址		深圳市深南路 6008 号特区报业大厦 1501	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址		广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 10 层	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		518034	200336
法定代表人		严震	任德奇

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	Bank of Communications (Hong Kong) Limited
	中文	-	交通银行（香港）有限公司
注册地址		-	香港中环毕打街 20 号
办公地址		-	香港中环毕打街 20 号
邮政编码		-	-

注：本基金无境外投资顾问。

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.byfunds.com
基金中期报告置备地点	基金管理人、基金托管人处

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	宝盈基金管理有限公司	广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 10 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据	2026 年 1 月 16 日（基金合同生效日）-2026 年 6 月 30 日	
和指标	宝盈恒生科技指数（QDII）A	宝盈恒生科技指数（QDII）C

本期已实现收益	-11, 576, 550. 28	-6, 142, 235. 04
本期利润	-103, 076, 920. 21	-51, 966, 310. 88
加权平均基金份 额本期利润	-0. 1838	-0. 1868
本期加权平均净 值利润率	-20. 11%	-20. 46%
本期基金份额净 值增长率	-18. 31%	-18. 40%
3. 1. 2 期末数据 和指标	报告期末 (2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	-92, 925, 806. 49	-48, 251, 063. 65
期末可供分配基 金份额利润	-0. 1831	-0. 1840
期末基金资产净 值	414, 534, 283. 45	213, 920, 616. 26
期末基金份额净 值	0. 8169	0. 8160
3. 1. 3 累计期末 指标	报告期末 (2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净 值增长率	-18. 31%	-18. 40%

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。

2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润采用期末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。

4、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。

5、本基金合同生效日为 2026 年 1 月 16 日，自合同生效日起至披露时点未满一年。

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

宝盈恒生科技指数（QDII）A

阶段	份额净	份额净值	业绩比较基	业绩比较基准	①－③	②－④
----	-----	------	-------	--------	-----	-----

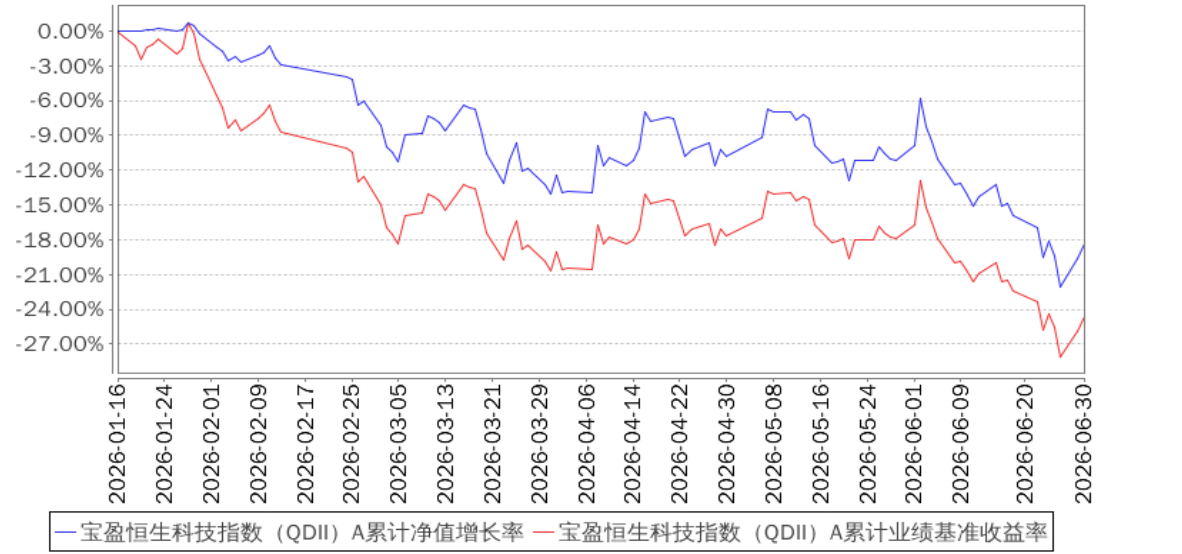
	值增长率①	增长率标准差②	准收益率③	收益率标准差④		
过去三个月	-4.97%	1.78%	-5.07%	1.79%	0.10%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-18.31%	1.56%	-24.66%	1.70%	6.35%	-0.14%

宝盈恒生科技指数（QDII）C

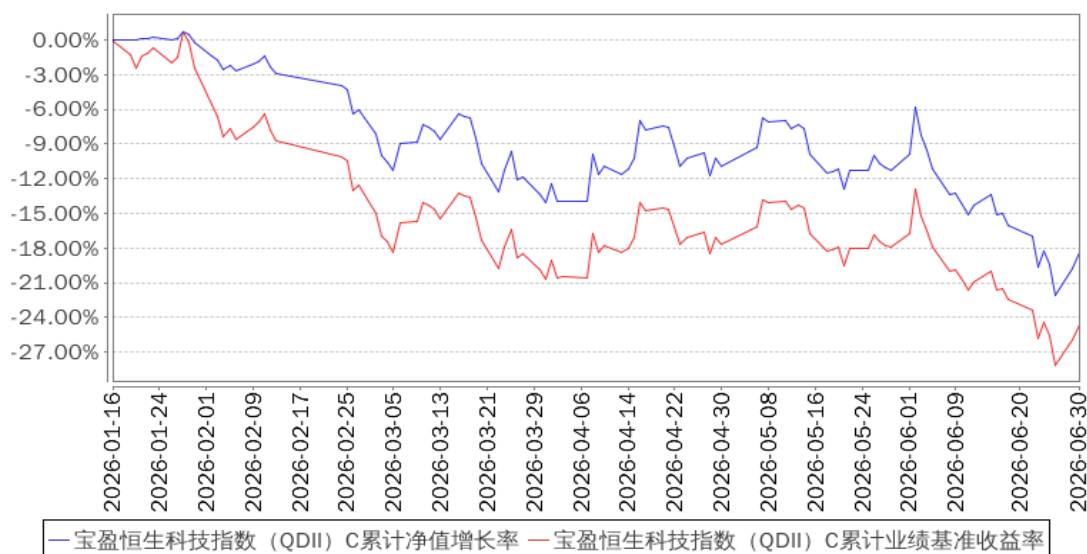
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-5.03%	1.78%	-5.07%	1.79%	0.04%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-18.40%	1.56%	-24.66%	1.70%	6.26%	-0.14%

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

宝盈恒生科技指数（QDII）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



宝盈恒生科技指数（QDII）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、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起的 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项资产配置比例将符合基金合同中的相关约定。

2、本基金合同生效日为 2026 年 1 月 16 日，自合同生效日起至披露时点未满一年。

§ 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

基金管理人：宝盈基金管理有限公司是 2001 年按照证监会“新的治理结构、新的内控体系”标准设立的首批基金管理公司之一，2001 年 5 月 18 日成立，注册资本为人民币 1 亿元，注册地在深圳。截至本报告期末，公司管理宝盈鸿利收益混合、宝盈泛沿海混合、宝盈策略增长混合、宝盈增强收益债券、宝盈资源优选混合、宝盈核心优势混合、宝盈货币、宝盈中证 A100 指数增强、宝盈新价值混合、宝盈祥瑞混合、宝盈科技 30 混合、宝盈睿丰创新混合、宝盈先进制造混合、宝盈新兴产业混合、宝盈转型动力混合、宝盈祥泰混合、宝盈优势产业混合、宝盈新锐混合、宝盈医疗健康沪港深股票、宝盈国家安全沪港深股票、宝盈互联网沪港深混合、宝盈消费主题混合（由原基金鸿阳转型而来）、宝盈盈泰纯债债券、宝盈人工智能股票、宝盈安泰短债债券、宝盈祥瑞定期开放混合、宝盈品牌消费股票、宝盈盈润纯债债券、宝盈融源可转债债券、宝盈聚丰两年定开债券、宝盈研究精选混合、宝盈鸿盛债券、宝盈龙头优选股票、宝盈祥明一年定开混合、宝盈盈旭纯债债券、宝盈现代服务业混合、宝盈创新驱动股票、宝盈聚福 39 个月定开债、宝盈发展新动能股票、宝盈祥裕增强回报混合、宝盈基础产业混合、宝盈智慧生活混合、宝盈祥庆 9 个月持有混合、宝盈优质成长混合、宝盈成长精选混合、宝盈品质甄选混合、宝盈祥和 9 个月定开混合、

宝盈安盛中短债债券、宝盈祥琪混合、宝盈国证证券龙头指数发起式、宝盈聚鑫一年定期开放债券发起式、宝盈半导体产业混合发起式、宝盈中证同业存单 AAA 指数 7 天持有、宝盈华证龙头红利 50 指数发起式、宝盈中债 0-5 年政策性金融债指数、宝盈纳斯达克 100 指数发起（QDII）、宝盈盈悦纯债债券、宝盈价值成长混合、宝盈北证 50 成份指数发起式、宝盈中债绿色普惠金融债券优选指数、宝盈创新医疗混合发起式、宝盈淳悦稳健配置 3 个月持有混合发起（FOF）、宝盈中证 A500 指数增强、宝盈恒生科技指数（QDII）、宝盈欣享稳健配置 6 个月持有混合发起（FOF）、宝盈数字经济混合发起式六十六只基金，公司恪守价值投资的投资理念，并逐渐形成了稳健、规范的投资风格。公司拥有一支经验丰富的投资管理团队，在研究方面，公司汇聚着一批从事宏观经济、行业、上市公司、债券和金融工程研究的专业人才，为公司的投资决策提供科学的研究支持；在投资方面，公司的基金经理具有丰富的证券市场投资经验，以自己的专业知识致力于获得良好业绩，努力为投资者创造丰厚的回报。

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		
蔡丹	本基金、宝盈国证证券龙头指数型发起式证券投资基金、宝盈祥和 9 个月定期开放混合型证券投资基金、宝盈祥庆 9 个月持有期混合型证券投资基金、宝盈祥裕增强回报混合型证券投资基金、宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金、宝盈华证龙头红利 50 指数型发起式证券投资基金、宝盈新锐灵活配置混合型证券投资基金、宝盈纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金（QDII）、宝盈中证 A100 指数增强型证券投资基金、宝盈北证 50 成份指数型发起式证券投资基金、宝盈中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理；量化投资部总经理	2026 年 1 月 16 日	-	15 年	蔡丹女士，CFA，中山大学概率论与数理统计硕士。曾任职于网易互动娱乐有限公司、广发证券股份有限公司，2011 年 9 月至 2017 年 7 月任职于长城证券股份有限公司，先后担任金融研究所金融工程研究员、资产管理部量化投资经理、执行董事。2017 年 7 月加入宝盈基金管理有限公司，中国国籍，证券投资基金从业人员资格。
侯嘉敏	本基金、宝盈鸿利收益灵活配置混合型证券投资基金、宝盈祥琪混合型证券投资基金基金经理。	2026 年 1 月 16 日	-	10 年	侯嘉敏先生，美国南加州大学金融工程硕士。2015 年 11 月加入宝盈基金管理有限公司，曾任研究员、基金经理助理。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。

注：1、本基金基金经理均为首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定，证券从业年限的计算截至 2026 年 6 月 30 日。

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

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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金无境外投资顾问。

4.3 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，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，无损害基金持有人利益的行为。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《宝盈基金管理有限公司公平交易制度》对本基金的日常交易行为进行监控，并定期制作公平交易分析报告，对不同投资组合的收益率、同向交易价差、反向交易价差作专项分析。报告结果表明，本基金在本报告期内的同向交易价差均在可合理解释范围之内；在本报告期内基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资活动中公平对待不同投资组合，公平交易制度执行情况良好，无损害基金持有人利益的行为。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，全球宏观环境呈现地缘冲突先抑后扬、科技竞赛全面升温、中美博弈系统性升级的三重特征。美伊冲突从 2 月底爆发到 4 月停战，经历了约六周的剧烈震荡，此后转入漫长的和平谈判；中美关系在关税领域边际缓和，而科技封锁在 6 月系统性升级至全链条监管新阶段。国内经济一季度 GDP 增长 5.0% 开局良好，但二季度回落至 4.3%，复苏斜率放缓，上半年 GDP 合计 69.57 万亿元，同比增长 4.7%。AI 产业链成为贯穿上半年的绝对主线，中国集成电路出口同比暴

增 96.1%，芯片超越手机和电脑成为出口头号商品。

海外方面，美联储上半年连续四次议息会议维持联邦基金利率 3.50%-3.75%不变，6 月 18 日新任主席沃什首次主持议息会议，删除全部利率前瞻指引，点阵图显示 9 位委员支持年内加息，美元指数上半年累计上涨约 3.2%。但人民币走出独立温和升值趋势，上半年美元相对人民币贬值 2.92%至 6.7852，核心驱动力为出口超高韧性持续结汇红利。美伊冲突对油价的冲击呈现脉冲式特征，WTI 原油从 3 月高点大幅回落，油价回落为全球风险资产提供喘息窗口。

2026 年上半年，港股市场整体表现弱势，恒生科技指数上半年累计下跌 18.36%，在全球主要科技指数中表现靠后。从节奏来看，1 月在跨年行情带动下上涨 3.67%；2 月 28 日美伊冲突爆发，2 月、3 月份分别下跌 10.15%、9.43%，风险偏好急转直下；4 月 8 日美伊停战后市场系统性修复，4 月反弹 4.96%；5 月美伊达成初步谅解备忘录框架，地缘风险溢价大幅回落，但恒生科技仅微涨 0.35%，修复力度显著弱于纳斯达克 100 等全球科技指数；6 月美国 5 月 CPI 同比升至 4.20%、PPI 飙升至 6.40%，全球央行紧缩预期升温，恒生科技大跌 8.13%。上半年行情呈现先扬后抑再修复再承压的陡峭节奏。

恒生科技指数于 2025 年 10 月初开始本轮调整，截至 2026 年 6 月 30 日，指数较 2025 年 10 月高点累计回撤 32.57%，近一年最大回撤达 35.89%。外部环境方面，美元指数与美债收益率持续维持高位，离岸港股被动承受流动性收紧压力，外资持续流出压制指数弹性。内部因素方面，互联网平台传统广告、电商、本地生活业务内需复苏力度偏弱，行业竞争持续压制盈利修复空间；港股科技资产以应用层平台为主，本轮全球 AI 行情核心红利集中于算力、半导体硬件环节，港股 AI 业绩弹性偏弱；板块内部极致分化，国产半导体制造等硬科技个股逆势走强，而互联网平台、智能汽车等调整幅度较大。

截至 2026 年 6 月 30 日，恒生科技指数 PE 为 21.58 倍，处于历史 23.08%分位数水平。与全球主要科技指数相比，恒生科技当前估值折价明显，但盈利能否企稳是估值修复的前置条件。2026 年 3 月 26 日，恒生指数公司发布优化恒生科技指数主题要求的披露，符合纳入资格的成份股业务须与网络、金融科技、云端、电子商贸、数码或智能化六大科技主题高度相关，规则的优化升级有助于提升指数的科技纯度与成长属性。

资金面方面，南向资金上半年累计净买入 3,010.43 亿港元，其中 1-4 月连续大幅净流入，5 月短暂净卖出 35.54 亿港元后 6 月回流 271.11 亿港元，南向资金在港股调整中逆势加仓，体现内地资金对港股中长期配置价值的认可。恒生科技 ETF 方面，上半年累计净申购 220.85 亿元，其中 1-3 月连续净申购，4-6 月转为连续净赎回，反映短期市场情绪在二季度末趋于谨慎，但 2025 年以来累计净申购仍达 1,091.43 亿元，为全市场指数 ETF 中规模最大的净申购品种之一，长期配置

型资金偏好未发生根本性改变。

宝盈恒生科技指数基金于 2026 年 1 月 16 日成立，之后进入封闭运作期，采用浮动建仓策略，在每日匀速建仓中枢仓位的基础上，依据当前估值所处历史分位数调节建仓速度，在估值相对低位加速建仓，在估值相对高位减速建仓。本基金于 2026 年 2 月 24 日开放申赎，开放申赎以来，本基金以复制指数的被动策略为主，通过量化手段控制跟踪误差，力争实现对恒生科技指数的紧密跟踪。二季度本基金 A 份额区间年化跟踪误差为 0.50%，较好地跟踪了指数的走势。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末宝盈恒生科技指数（QDII）A 的基金份额净值为 0.8169 元，本报告期基金份额净值增长率为-18.31%；截至本报告期末宝盈恒生科技指数（QDII）C 的基金份额净值为 0.8160 元，本报告期基金份额净值增长率为-18.40%。同期业绩比较基准收益率为-24.66%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年下半年，港股市场面临的宏观环境与上半年既有延续也有变化。地缘政治方面，美伊已敲定 60 天最终协议谈判路线图，霍尔木兹海峡航运有望分阶段修复，原油价格持续回落有助于缓解全球通胀压力、削弱美联储加息必要性，为港股估值修复创造有利外部条件。但中美博弈时间表密集，7 月高端制造关税复审、8 月对华贸易地位结论、年底科技出口管制再升级，任何超预期升级都可能引发市场波动。国内方面，二季度 GDP 增速回落至 4.3%，市场对下半年政策发力预期增强，央行 7 月 15 日明确表示降准还有空间，稳增长政策持续落地、内需复苏信号是港股趋势性反弹的关键变量。

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和基金合同关于估值的约定，对基金持有的投资品种进行估值。基金托管人根据法律法规要求对基金管理公司采用的估值政策和程序进行核查，并对估值结果及净值计算进行复核。

本基金管理人设立估值委员会，由公司投研、运营的分管领导、督察长及研究部、投资部门（权益投资部、固定收益部等）、风险管理部、基金运营部、监察稽核部总经理共同组成，以上人员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。估值委员会负责制定、修订和完善公司估值政策和程序，定期评价估值政策和程序修订的适用性。日常基金资产的估值程序，由基金运营部负责执行。对需要进行估值调整的投资品种，管理人启动估值调整程序，并与基金托管人协商一致，必要时征求会计师事务所的专业意见，由估值委员会议定估值方案，基金运营部具体执行。

截止报告期末，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建立业务合作关系，由其按约定提供有关债券品种、流通受限股票等估值参考数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 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

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，基金托管人在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期，宝盈基金管理有限公司在本基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期，由宝盈基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关本基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：宝盈恒生科技指数型证券投资基金（QDII）

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	45,223,633.33
结算备付金		2,610,520.22
存出保证金		77,695.75
交易性金融资产	6.4.7.2	598,324,375.49
其中：股票投资		595,292,898.50
基金投资		—

债券投资		3,031,476.99
资产支持证券投资		—
贵金属投资		—
其他投资		—
衍生金融资产	6.4.7.3	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—
债权投资	6.4.7.5	—
其中：债券投资		—
资产支持证券投资		—
其他投资		—
其他债权投资	6.4.7.6	—
其他权益工具投资	6.4.7.7	—
应收清算款		8,825,552.42
应收股利		1,348,095.10
应收申购款		195,649.82
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.8	—
资产总计		656,605,522.13
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日
负 债：		
短期借款		—
交易性金融负债		—
衍生金融负债	6.4.7.3	—
卖出回购金融资产款		—
应付清算款		—
应付赎回款		27,727,867.59
应付管理人报酬		283,529.60
应付托管费		56,705.91
应付销售服务费		47,855.36
应付投资顾问费		—
应交税费		110.88
应付利润		—
递延所得税负债		—
其他负债	6.4.7.9	34,553.08
负债合计		28,150,622.42
净资产：		
实收基金	6.4.7.10	769,631,769.85
未分配利润	6.4.7.11	-141,176,870.14
净资产合计		628,454,899.71
负债和净资产总计		656,605,522.13

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，宝盈恒生科技指数型证券投资基金（QDII）A 类基金份额净值人民币 0.8169 元，A 类基金份额 507,460,089.94 份；C 类基金份额净值人民币 0.8160 元，C

类基金份额 262,171,679.91 份；宝盈恒生科技指数型证券投资基金（QDII）基金份额总额合计为 769,631,769.85 份。

6.2 利润表

会计主体：宝盈恒生科技指数型证券投资基金（QDII）

本报告期：2026 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 16 日（基金合同 生效日）至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-152,635,229.89
1. 利息收入		810,613.00
其中：存款利息收入	6.4.7.12	338,293.35
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		472,319.65
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-16,128,397.17
其中：股票投资收益	6.4.7.13	-20,148,904.83
基金投资收益	6.4.7.14	-
债券投资收益	6.4.7.15	5,175.87
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-
股利收益	6.4.7.19	4,015,331.79
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-137,324,445.77
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		1,137.29
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	5,862.76
减：二、营业总支出		2,408,001.20
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,734,869.02
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	346,973.80
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	287,431.17
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		18.61
8. 其他费用	6.4.7.23	38,708.60
三、利润总额（亏损总额以“-”号		-155,043,231.09

填列)		
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-155,043,231.09
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-155,043,231.09

注：本基金合同生效日为 2026 年 1 月 16 日，无上年可比期间数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：宝盈恒生科技指数型证券投资基金（QDII）

本报告期：2026 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2026 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
二、本期期初净资产	869,954,852.54	-	-	869,954,852.54
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-100,323,082.69	-	-141,176,870.14	-241,499,952.83
（一）、综合收益总额	-	-	-155,043,231.09	-155,043,231.09
（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）	-100,323,082.69	-	13,866,360.95	-86,456,721.74
其中：1. 基金申购款	36,025,206.02	-	-4,074,957.48	31,950,248.54
2. 基金赎回款	-136,348,288.71	-	17,941,318.43	-118,406,970.28
（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、本期期末净资产	769,631,769.85	-	-141,176,870.14	628,454,899.71

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

葛俊杰

基金管理人负责人

张献锦

主管会计工作负责人

何瑜

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

宝盈恒生科技指数型证券投资基金(QDII) (以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2025]第 2538 号《关于准予宝盈恒生科技指数型证券投资基金(QDII)注册的批复》核准,由宝盈基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《宝盈恒生科技指数型证券投资基金(QDII)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 869,867,868.70 元,业经容诚会计师事务所(特殊普通合伙)容诚验字[2026]200Z0016 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《宝盈恒生科技指数型证券投资基金(QDII)基金合同》于 2026 年 1 月 16 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 869,954,852.54 份基金份额,其中认购资金利息折合 86,983.84 份基金份额。本基金的基金管理人为宝盈基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《宝盈恒生科技指数型证券投资基金(QDII)基金合同》和《宝盈恒生科技指数型证券投资基金(QDII)招募说明书》并报中国证监会备案,本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购、申购时收取认购、申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别,称为 A 类基金份额;在投资人认购、申购时不收取认购、申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,并从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别,称为 C 类基金份额。A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码,分别计算和公告各类基金份额净值和各类基金份额累计净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资人认购、申购基金份额时可自由选择基金份额类别,本基金不同基金份额类别之间不得相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《宝盈恒生科技指数型证券投资基金(QDII)基金合同》的有关规定,本基金主要投资于标的指数成份股,备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金还可投资于在境内外市场依法发行的金融工具。境外市场投资工具包括香港市场的公募基金(包括开放式基金和交易型开放式基金(ETF));香港交易所挂牌交易的普通股,优先股,存托凭证,房地产信托凭证;政府债券,公司债券,可转换债券,住房按揭支持证券,资产支持证券以及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券;银行存款,可转让存单,银行承兑汇票,银行票据,商业票据,回购协议,短期政府债券等货币市场工具;与固定收益,股权,信用,商品

指数，基金等标的物挂钩的结构性投资产品；远期合约，互换香港交易所上市交易的权证，期权，期货等金融衍生产品；以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本基金还可以进行证券借贷交易、正回购交易、逆回购交易。香港市场可通过合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度或内地与香港股票市场交易互联互通机制进行投资。境内市场投资工具包括国内依法发行或上市的股票（包括主板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票，存托凭证），债券（包括国债，金融债，地方政府债，公开发行的次级债券，政府支持债券，政府支持机构债券，企业债，公司债，可转换债券（含可分离交易可转债），可交换债券，央行票据，短期融资券，超短期融资券，中期票据等），国债期货，股指期货，股票期权，银行存款，同业存单，货币市场工具，债券回购，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（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。

基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%；投资于标的指数成份股，备选成份股的资产比例不得低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货，股票期权和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金，存出保证金，应收申购款等。本基金的业绩比较基准为恒生科技指数收益率（使用估值汇率调整） $\times 95\%$ + 商业银行人民币活期存款利率（税后） $\times 5\%$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》《证券投资基金会计核算业务指引》《宝盈恒生科技指数型证券投资基金（QDII）基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2026 年中期财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2026 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2026 年 1 月 16 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产

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

债务工具

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

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

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

(2) 金融负债

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

(3) 衍生金融工具

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

6.4.4 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。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分

别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

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

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

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

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

6.4.4.8 损益平准金

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

6.4.4.8 损益平准金

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除股票交易所在地适用的预缴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。

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后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

6.4.4.9 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股票交易所在地适用的预缴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。

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后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.14 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：

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《财政部 税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关境内外财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

(2) 对基金从境内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。

目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的境内企业债券利息收入，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。

目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所

上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(4) 基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	45,223,633.33
等于：本金	45,218,375.21
加：应计利息	5,258.12
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	45,223,633.33

注：货币资金中包括以下外币余额：活期存款 20,621,497.92 港币(折合人民币 17,910,802.02 元)。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		732,616,494.27	-	595,292,898.50	-137,323,595.77
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	3,002,950.00	29,376.99	3,031,476.99	-850.00
	银行间市	-	-	-	-

	场				
	合计	3,002,950.00	29,376.99	3,031,476.99	-850.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		735,619,444.27	29,376.99	598,324,375.49	-137,324,445.77

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	13,210.46
其中：交易所市场	13,210.46
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	21,342.62
合计	34,553.08

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

宝盈恒生科技指数（QDII）A

项目	本期 2026 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	581,632,295.12	581,632,295.12
本期申购	17,612,199.74	17,612,199.74
本期赎回（以“-”号填列）	-91,784,404.92	-91,784,404.92
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	507,460,089.94	507,460,089.94

宝盈恒生科技指数（QDII）C

项目	本期 2026 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	288,322,557.42	288,322,557.42
本期申购	18,413,006.28	18,413,006.28

本期赎回（以“-”号填列）	-44,563,883.79	-44,563,883.79
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	262,171,679.91	262,171,679.91

6.4.7.11 未分配利润

单位：人民币元

宝盈恒生科技指数（QDII）A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	-11,576,550.28	-91,500,369.93	-103,076,920.21
本期基金份额交易产生的变动数	703,398.19	9,447,715.53	10,151,113.72
其中：基金申购款	-130,215.44	-1,896,460.25	-2,026,675.69
基金赎回款	833,613.63	11,344,175.78	12,177,789.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-10,873,152.09	-82,052,654.40	-92,925,806.49

宝盈恒生科技指数（QDII）C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	-6,142,235.04	-45,824,075.84	-51,966,310.88
本期基金份额交易产生的变动数	258,673.36	3,456,573.87	3,715,247.23
其中：基金申购款	-150,407.67	-1,897,874.12	-2,048,281.79
基金赎回款	409,081.03	5,354,447.99	5,763,529.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-5,883,561.68	-42,367,501.97	-48,251,063.65

6.4.7.12 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	317,161.44
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	21,071.43
其他	60.48
合计	338,293.35

6.4.7.13 股票投资收益

6.4.7.13.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月16日（基金合同生效日）至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-20,148,904.83
股票投资收益——赎回差价收入	-
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	-20,148,904.83

6.4.7.13.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月16日（基金合同生效日）至2026年6月30日
卖出股票成交总额	129,447,238.88
减：卖出股票成本总额	148,219,381.19
减：交易费用	1,376,762.52
买卖股票差价收入	-20,148,904.83

6.4.7.13.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.14 基金投资收益

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月16日（基金合同生效日）至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	5,175.87
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	5,175.87

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

股票投资产生的股利收益	4,015,331.79
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	4,015,331.79

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-137,324,445.77
股票投资	-137,323,595.77
债券投资	-850.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
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	-137,324,445.77

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	5,862.76
合计	5,862.76

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	21,342.62
信息披露费	-
证券出借违约金	-
证券组合费	16,541.44

银行汇划费用	424.54
其他	400.00
合计	38,708.60

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无须披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系以及其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
宝盈基金管理有限公司（“宝盈基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、基金销售机构
交通银行（香港）有限公司（“交行香港”）	境外资产托管人
中国对外经济贸易信托有限公司（“中国外贸信托”）	基金管理人的股东
中铁信托有限责任公司（“中铁信托”）	基金管理人的股东
中铁宝盈资产管理有限公司（“中铁宝盈”）	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 基金交易

无。

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,734,869.02
其中：应支付销售机构的客户维护费	866,695.02
应支付基金管理人的净管理费	868,174.00

注：1、支付基金管理人宝盈基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%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：日基金管理报酬=前一日基金资产净值×0.50%/当年天数。

2、本基金合同生效日为 2026 年 1 月 16 日，无上年可比期间数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	346,973.80

注：1、支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10%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：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

2、本基金合同生效日为 2026 年 1 月 16 日，无上年可比期间数据。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2026 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	宝盈恒生科技指数 (QDII) A	宝盈恒生科技指数 (QDII) C	合计
宝盈基金	—	64.74	64.74
交通银行	—	266,069.04	266,069.04
合计	—	266,133.78	266,133.78

注：1、支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金 C 类份额的基金资产净值 0.25%的年费率

计提，逐日累计至每月月底，按月支付给宝盈基金公司，再由宝盈基金公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日基金销售服务费=前一日基金 C 类份额的基金资产净值×0.25%/当年天数。

2、本基金合同生效日为 2026 年 1 月 16 日，无上年可比期间数据。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行	27,312,831.31	317,066.86
交行香港	17,910,802.02	94.58

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行和境外托管人交行香港保管，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。本基金为指数型基金，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。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金还可投资于在境内外市场依法发行的金融工具。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本基金进行被动指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去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同类风险损失的频度。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

具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金托管人交通银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	3,031,476.99
合计	3,031,476.99

注：于 2026 年 6 月 30 日，未评级部分为国债。债券信用评级取自第三方评级机构。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。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。

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；并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。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	45,223,633.33	-	-	-	45,223,633.33
结算备付金	2,610,520.22	-	-	-	2,610,520.22
存出保证金	77,695.75	-	-	-	77,695.75
交易性金融资产	3,031,476.99	-	-	-595,292,898.50	598,324,375.49
应收股利	-	-	-	1,348,095.10	1,348,095.10
应收申购款	-	-	-	195,649.82	195,649.82
应收清算款	-	-	-	8,825,552.42	8,825,552.42
资产总计	50,943,326.29	-	-	-605,662,195.84	656,605,522.13
负债					
应付赎回款	-	-	-	27,727,867.59	27,727,867.59
应付管理人报酬	-	-	-	283,529.60	283,529.60
应付托管费	-	-	-	56,705.91	56,705.91
应付销售服务费	-	-	-	47,855.36	47,855.36
应交税费	-	-	-	110.88	110.88
其他负债	-	-	-	34,553.08	34,553.08
负债总计	-	-	-	28,150,622.42	28,150,622.42
利率敏感度缺口	50,943,326.29	-	-	-577,511,573.42	628,454,899.71

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为 0.48%，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
货币资金	-	17,910,802.02	-	17,910,802.02
交易性金融资产	-	595,292,898.50	-	595,292,898.50
应收清算款	-	1,679,141.48	-	1,679,141.48
资产合计	-	614,882,842.00	-	614,882,842.00
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇 风险敞口净额	-	614,882,842.00	-	614,882,842.00

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变	
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2026 年 6 月 30 日）
分析	1. 所有外币相对人民币升值 5%	30,744,142.10
-	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-30,744,142.10

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场

交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，对指数投资部分采用完全复制法，按照成份股在为恒生科技指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。本基金进行被动指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金将不低于 80%的基金资产投资于为恒生科技指数成份股、备选成份股，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	595,292,898.50	94.72
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	595,292,898.50	94.72

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除恒生科技指数收益率以外的其他市场变量保持不变	
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2026 年 6 月 30 日）
分析	1. 恒生科技指数收益率上升 5%	23,996,279.95
—	2. 恒生科技指数收	-23,996,279.95

	益率下降 5%	
--	---------	--

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日
第一层次	595,292,898.50
第二层次	3,031,476.99
第三层次	—
合计	598,324,375.49

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	595,292,898.50	90.66
	其中：普通股	595,292,898.50	90.66
	存托凭证	—	—
	优先股	—	—
	房地产信托凭证	—	—
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	3,031,476.99	0.46
	其中：债券	3,031,476.99	0.46
	资产支持证券	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
	其中：远期	—	—
	期货	—	—
	期权	—	—
	权证	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	货币市场工具	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	47,834,153.55	7.29
8	其他各项资产	10,446,993.09	1.59
9	合计	656,605,522.13	100.00

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 454,586,139.05 元，占净值比为 72.33%。

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
中国香港	595,292,898.50	94.72
合计	595,292,898.50	94.72

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

7.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
原材料	—	—
非周期性消费品	224,140,188.38	35.67
周期性消费品	10,113,264.18	1.61
能源	—	—
金融	—	—

医疗	-	-
工业	-	-
信息科技	194,627,046.46	30.97
电信服务	166,412,399.48	26.48
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	595,292,898.50	94.72

注：以上分类采用国际通用的行业分类标准。

7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的权益投资。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

7.4.1 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权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	Semiconductor Manufacturing Inc	中芯国际集成电路制造有限公司	981 HK	深港通联合市场	中国香港	777,500	60,371,607.68	9.61
2	NetEase Inc	网易股份有限公司	9999 HK	香港联合交易所	中国香港	324,900	57,115,639.55	9.09
3	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股有限公司	700 HK	深港通联合市场	中国香港	132,300	49,387,959.12	7.86
4	Meituan	美团	3690 HK	深港通联合市场	中国香港	745,000	44,324,277.88	7.05
5	BYD Co Ltd	比亚迪股份有限公司	1211 HK	深港通联合市场	中国香港	658,400	41,430,773.03	6.59
6	Xiaomi Corp	小米集团	1810 HK	深港通联合市场	中国香港	2,150,600	40,421,434.55	6.43
7	Alibaba Group Holding Ltd	阿里巴巴集团控股有限公司	9988 HK	深港通联合市场	中国香港	486,600	39,241,792.53	6.24
8	Hua Hong Grace Semiconductor L	华虹宏力半导体有限公司	1347 HK	深港通联合市场	中国香港	164,000	30,653,561.44	4.88
9	Baidu	百度集团	9888 HK	香港联合	中国香港	310,050	29,514,614.45	4.70

	Inc	股份有限公司		交易所				
10	JD.com Inc	京东集团股份有限公司	9618 HK	香港联合交易所	中国香港	326,700	28,162,712.04	4.48
11	Lenovo Group Ltd	联想集团有限公司	992 HK	深港通联合市场	中国香港	1,398,000	27,951,641.36	4.45
12	Kuaishou Technology	快手科技	1024 HK	深港通联合市场	中国香港	624,200	22,553,394.66	3.59
13	Trip.com Group Ltd	携程集团有限公司	9961 HK	香港联合交易所	中国香港	56,550	15,304,702.18	2.44
14	XPeng Inc	小鹏集团	9868 HK	深港通联合市场	中国香港	333,200	14,658,153.56	2.33
15	Li Auto Inc	理想汽车	2015 HK	深港通联合市场	中国香港	287,500	11,506,550.40	1.83
16	Midea Group Co Ltd	美的集团股份有限公司	300 HK	深港通联合市场	中国香港	126,700	9,089,740.54	1.45
17	Haier Smart Home Co Ltd	海尔智家股份有限公司	6690 HK	深港通联合市场	中国香港	496,800	8,621,282.89	1.37
18	Horizon Robotics	地平线	9660 HK	深港通联合市场	中国香港	2,401,200	8,509,094.02	1.35
19	Sensetime Group Inc	商汤集团股份有限公司	20 HK	深港通联合市场	中国香港	7,038,000	8,191,225.57	1.30
20	Sunny Optical Technology Group	舜宇光学科技(集团)有限公司	2382 HK	深港通联合市场	中国香港	143,600	7,608,150.58	1.21
21	Bilibili Inc	哔哩哔哩股份有限公司	9626 HK	深港通联合市场	中国香港	65,300	7,469,538.69	1.19
22	Z AI Co Ltd	北京智谱华章科技股份有限公司	2513 HK	香港联合交易所	中国香港	3,600	6,578,745.12	1.05

23	JD Health International Inc	京东健康股份有限公司	6618 HK	深港通联合市场	中国香港	230,200	6,566,036.50	1.04
24	Zhejiang Leapmotor Technology	浙江零跑科技股份有限公司	9863 HK	深港通联合市场	中国香港	150,700	4,513,103.92	0.72
25	NIO Inc	蔚来集团	9866 HK	香港联合交易所	中国香港	126,940	4,271,229.77	0.68
26	Alibaba Health Information Technology	阿里健康信息技术有限公司	241 HK	深港通联合市场	中国香港	1,326,000	3,547,227.68	0.56
27	Tongcheng Travel Holdings Ltd	同程旅行控股有限公司	780 HK	深港通联合市场	中国香港	289,600	3,015,869.64	0.48
28	BYD Electronic International Co., Ltd.	比亚迪电子(国际)有限公司	285 HK	深港通联合市场	中国香港	162,000	2,943,550.69	0.47
29	Minimax Group Inc	Minimax Group Inc	100 HK	香港联合交易所	中国香港	3,860	1,398,035.45	0.22
30	Tencent Music Entertainment Group	腾讯音乐娱乐集团	1698 HK	香港联合交易所	中国香港	13,000	371,253.01	0.06

注：本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

7.4.2 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权益投资明细

无。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期末基金资产净
----	----------	------	----------	----------

				值比例(%)
1	Xiaomi Corp	1810 HK	74,507,007.45	11.86
2	Meituan	3690 HK	71,675,173.58	11.40
3	Tencent Holdings Ltd	700 HK	71,036,261.44	11.30
4	Alibaba Group Holding Ltd	9988 HK	71,012,383.15	11.30
5	Semiconductor Manufacturing In	981 HK	69,987,182.03	11.14
6	BYD Co Ltd	1211 HK	69,737,070.25	11.10
7	NetEase Inc	9999 HK	61,150,637.26	9.73
8	Kuaishou Technology	1024 HK	45,172,859.48	7.19
9	Baidu Inc	9888 HK	41,475,457.90	6.60
10	JD.com Inc	9618 HK	40,689,680.63	6.47
11	Trip.com Group Ltd	9961 HK	24,443,512.80	3.89
12	XPeng Inc	9868 HK	24,141,137.81	3.84
13	Horizon Robotics	9660 HK	21,454,509.90	3.41
14	Li Auto Inc	2015 HK	19,870,873.84	3.16
15	Hua Hong Grace Semiconductor L	1347 HK	17,548,826.57	2.79
16	SenseTime Group Inc	20 HK	17,119,481.17	2.72
17	Bilibili Inc	9626 HK	16,355,374.25	2.60
18	Lenovo Group Ltd	992 HK	15,380,881.64	2.45
19	JD Health International Inc	6618 HK	14,170,953.67	2.25
20	Haier Smart Home Co Ltd	6690 HK	13,539,925.91	2.15

注：1、本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

2、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。

3、买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	Semiconductor Manufacturing In	981 HK	21,952,384.38	3.49
2	BYD Co Ltd	1211 HK	12,445,937.02	1.98
3	Meituan	3690 HK	11,611,955.25	1.85
4	JD.com Inc	9618 HK	8,236,345.42	1.31
5	Xiaomi Corp	1810 HK	7,978,001.13	1.27
6	Lenovo Group Ltd	992 HK	6,389,639.52	1.02

7	Tencent Holdings Ltd	700 HK	5,574,184.39	0.89
8	Kingdee International Software	268 HK	4,859,155.75	0.77
9	NetEase Inc	9999 HK	4,696,032.00	0.75
10	Kingsoft Corp Ltd	3888 HK	4,664,531.92	0.74
11	Z AI Co Ltd	2513 HK	4,649,503.56	0.74
12	Hua Hong Grace Semiconductor L	1347 HK	3,715,596.89	0.59
13	Kuaishou Technology	1024 HK	3,698,436.19	0.59
14	Alibaba Group Holding Ltd	9988 HK	3,458,010.79	0.55
15	Horizon Robotics	9660 HK	2,598,772.77	0.41
16	Minimax Group Inc	100 HK	2,453,230.87	0.39
17	XPeng Inc	9868 HK	2,452,555.15	0.39
18	Baidu Inc	9888 HK	2,321,818.64	0.37
19	Li Auto Inc	2015 HK	1,984,568.50	0.32
20	Bilibili Inc	9626 HK	1,675,143.56	0.27

- 注：1、本基金对以上证券代码采用当地市场代码。
- 2、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。
- 3、卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	880,835,875.46
卖出收入（成交）总额	129,447,238.88

注：买入股票成本（成交）总额、卖出股票收入（成交）总额，均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

债券信用等级	公允价值	占基金资产净值比例（%）
未评级	3,031,476.99	0.48

注：本债券投资组合主要采用国际标准债券信用评级信息。未评级持仓为中国国债和政策性金融债。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019792	25 国债 19	3,000,000	3,031,476.99	0.48

注：数量列示债券面值，外币按照期末估值汇率折为人民币，四舍五入保留整数。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

无。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

无。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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

本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	77,695.75
2	应收清算款	8,825,552.42
3	应收股利	1,348,095.10
4	应收利息	-
5	应收申购款	195,649.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,446,993.09

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的股票。

7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

7.11.6 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，分项与合计项之间可能存在尾差

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人 户数 (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 (%)
宝盈恒生 科技指数 (QDII) A	2,180	232,779.86	—	—	507,460,089.94	100.00
宝盈恒生 科技指数 (QDII) C	3,211	81,647.99	—	—	262,171,679.91	100.00
合计	5,391	142,762.34	—	—	769,631,769.85	100.00

注：1、本基金采用分级模式核算，机构/个人投资者持有基金份额占总份额比例的计算中分母采用各自级别的基金份额来计算。

2、户均持有的基金份额合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	宝盈恒生科技指数（QDII）A	10,101.07	0.0020
	宝盈恒生科技指数（QDII）C	3,192.32	0.0012
	合计	13,293.39	0.0017

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	宝盈恒生科技指数（QDII）A	0
	宝盈恒生科技指数（QDII）C	0
	合计	0

本基金基金经理持有本 开放式基金	宝盈恒生科技指数（QDII）A	0
	宝盈恒生科技指数（QDII）C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	宝盈恒生科技指数（QDII）A	宝盈恒生科技指数（QDII）C
基金合同生效日 （2026 年 1 月 16 日） 基金份额总额	581,632,295.12	288,322,557.42
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	17,612,199.74	18,413,006.28
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	91,784,404.92	44,563,883.79
基金合同生效日起至 报告期期末基金拆分 变动份额	—	—
本报告期期末基金份 额总额	507,460,089.94	262,171,679.91

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、报告期内，本基金管理人重大人事变动情况如下：

根据第七届董事会第二十次会议决议，同意邹纯余不再担任公司副总经理职务。

根据第七届董事会第二十一次会议决议和股东会 2026 年第 2 次会议决议，同意杨凯辞去公司总经理职务，不再担任总经理、董事；同意聘任葛俊杰为公司总经理，同时担任公司董事。

以上变更事项已按规定向中国证券监督管理委员会深圳证监局报告以及向中国证券投资基金业协会报备，并发布基金行业高级管理人员变更公告。

2、本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金管理人的基金投资策略遵循本基金《基金合同》中规定的投资策略，未发生显著改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内未发生改聘会计师事务所情况。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
国泰海通证券	2	797,094,616.54	78.90	98,067.19	49.06	—
China International Capital Corporation HK Securities Ltd.	2	200,556,373.57	19.85	100,278.31	50.16	—
中泰证券	2	12,632,124.23	1.25	1,553.66	0.78	—
长江证券	2	—	—	—	—	—
东方财富证券	2	—	—	—	—	—
光大证券	1	—	—	—	—	—

广发证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-

注：1、本基金管理人选择证券公司参与证券交易的标准和程序

（1）证券公司选择标准

公司选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司参与证券交易服务，具体包括以下三点：

- ① 证券公司有较强的证券交易服务能力，配置有相应的人员岗位以及信息系统，能提供安全、便捷、优质的证券交易服务。
- ② 证券公司有健全的研究服务内部管理制度，较强的研究人才队伍，专业的研究服务能力、较高的业务质量和合规水平等，有严格的研究服务从业人员执业行为规范，在研报解读、跟踪研究等方面能提供专业、审慎的研究服务。
- ③ 证券公司有完善的内部考核机制，能有效防范基金销售与证券交易、研究服务等业务的利益冲突。

（2）证券公司选择流程

- ① 通过信息收集、背景调查等工作，对证券公司进行准入评价，完成准入评价报告。
- ② 对于符合准入条件的证券公司，在提供至少一个季度以上的投研服务后，若服务评价总得分能够进入前五名，或有两个行业服务评价得分能进入前五名，则可选择其参与证券交易。
- ③ 发起证券公司选择内部流程，流程中应包括证券公司准入评价报告、服务评价等材料，经公司审批通过后执行。

2、本基金本报告期交易单元变更情况：

（1）新租交易单元：东方财富证券上海、深圳交易单元各一个；中泰证券上海、深圳交易单元各一个；国泰海通证券上海、深圳交易单元各一个；国盛证券上海、深圳交易单元各一个；天风证券上海、深圳交易单元各一个；广发证券上海、深圳交易单元各一个；招商证券上海、深圳交易单元各一个；长江证券上海、深圳交易单元各一个；光大证券深圳交易单元一个；开源证券深圳交易单元一个。

（2）无退租交易单元。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	债券回购交易	权证交易	基金交易
------	------	--------	------	------

	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例 (%)	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例 (%)	成交金额	占当期 权证成 交总额 的比例 (%)	成交金额	占当期 基金成 交总额 的比例 (%)
国泰海通 证券	-	-	5,331,80 0,000.00	100.00	-	-	-	-
China Internati onal Capital Corporati on HK Securitie s Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	3,002,95 0.00	100.00	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	宝盈基金管理有限公司关于终止浦领基金销售有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2026 年 6 月 30 日
2	宝盈基金管理有限公司关于终止深圳富济基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2026 年 6 月 23 日
3	宝盈基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露	2026 年 5 月 29 日

		网站	
4	宝盈基金管理有限公司关于增加招商银行股份有限公司销售旗下部分基金的公告	证券时报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2026 年 4 月 29 日
5	宝盈恒生科技指数型证券投资基金（QDII）2026 年第 1 季度报告	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2026 年 4 月 22 日
6	宝盈基金管理有限公司旗下 65 只基金 2026 年第一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	2026 年 4 月 22 日
7	宝盈基金管理有限公司关于增加深圳前海微众银行股份有限公司销售旗下部分基金的公告	证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2026 年 4 月 9 日
8	宝盈恒生科技指数型证券投资基金（QDII）开放日常申购、定期定额投资业务及限制大额申购、定期定额投资业务的公告	证券时报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2026 年 4 月 2 日
9	宝盈基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2026 年 3 月 31 日
10	宝盈基金管理有限公司旗下 63 只基金 2025 年年度报告提示性公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2026 年 3 月 30 日
11	宝盈基金管理有限公司关于增加华宝证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告	上海证券报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2026 年 3 月 9 日
12	宝盈基金管理有限公司关于增加平安银行股份有限公司销售旗下部分基金的公告-20260306	证券时报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2026 年 3 月 9 日
13	宝盈恒生科技指数型证券投资基金（QDII）2026 年境外主要市场节假日及非交易日暂停申购、赎回等交易类业务的公告	证券时报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2026 年 2 月 12 日
14	宝盈恒生科技指数型证券投资基金（QDII）开放日常赎回业务的公告	证券时报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2026 年 2 月 12 日
15	关于宝盈恒生科技指数型证券投资基金（QDII）增加国盛证券有限责任公司为代销机构的公告	证券时报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2026 年 1 月 28 日
16	宝盈基金管理有限公司旗下 63 只基金 2025 年第四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	2026 年 1 月 22 日
17	宝盈恒生科技指数型证券投资基金	证券时报, 本基金管理人	2026 年 1 月 17 日

	（QDII）基金合同生效公告	人网站, 中国证监会基金电子披露网站	
18	宝盈基金管理有限公司关于宝盈恒生科技指数型证券投资基金（QDII）提前结束募集的公告	证券时报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2026 年 1 月 9 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

中国证监会准予宝盈恒生科技指数型证券投资基金（QDII）注册的文件。

《宝盈恒生科技指数型证券投资基金（QDII）基金合同》。

《宝盈恒生科技指数型证券投资基金（QDII）托管协议》。

法律意见书。

基金管理人业务资格批件、营业执照。

基金托管人业务资格批件、营业执照。

中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

基金管理人办公地址：广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 10 层

基金托管人办公地址：上海市长宁区仙霞路 18 号

12.3 查阅方式

上述备查文件文本分别存放在基金管理人和基金托管人的办公场所，在办公时间内基金持有人可免费查阅。

宝盈基金管理有限公司

2026 年 8 月 28 日