

宝盈中证 A500 指数增强型证券投资基金 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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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 1 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 信息披露方式	6
2.5 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 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	60
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	62

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	62
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	62
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	62
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	62
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
7.12 投资组合报告附注	63
§ 8 基金份额持有人信息	63
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64
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	64
§ 9 开放式基金份额变动	64
§ 10 重大事件揭示	65
10.1 基金份额持有人大会决议	65
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	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	65
10.4 基金投资策略的改变	65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	65
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	66
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	66
10.8 其他重大事件	67
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	68
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	68
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	68
§ 12 备查文件目录	69
12.1 备查文件目录	69
12.2 存放地点	69
12.3 查阅方式	69

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	宝盈中证 A500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	宝盈中证 A500 指数增强	
基金主代码	023514	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 12 月 9 日	
基金管理人	宝盈基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	126, 129, 545. 84 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	宝盈中证 A500 指数增强 A	宝盈中证 A500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	023514	023515
报告期末下属分级基金的份额总额	43, 662, 932. 56 份	82, 466, 613. 28 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的跟踪误差基础上，通过数量化投资方法进行积极的组合管理与风险控制，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金为股票指数增强型基金，指数化投资部分将按照成份股在中证 A500 指数中的基准权重构建投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。指数增强投资部分主要通过公司内部的数量化选股模型，实行积极的配置策略，在跟踪标的指数的同时争取获得超越标的指数的收益。在正常市场情况下，本基金力争实现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不超过 0. 5%，年化跟踪误差不超过 7. 75%。 本基金的投资策略主要包括股票投资策略、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、金融衍生工具投资策略、参与融资业务策略、参与转融通证券出借业务策略、存托凭证投资策略等。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。本基金为股票指数增强型基金，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。 本基金可投资于港股通标的股票，会面临汇率风险和港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张磊	张姗
	联系电话	0755-83276688	400-61-95555
	电子邮箱	zhangl@byfunds.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-8888-300	400-61-95555
传真		0755-83515599	0755-83195201
注册地址		深圳市深南路 6008 号特区报业大厦 1501	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		518034	518040
法定代表人		严震	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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

2.5 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 和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	宝盈中证 A500 指数增强 A	宝盈中证 A500 指数增强 C
本期已实现收益	5,649,377.17	6,903,724.24
本期利润	8,992,871.14	15,806,755.03
加权平均基金份 额本期利润	0.1372	0.1921
本期加权平均净 值利润率	13.14%	18.32%
本期基金份额净 值增长率	15.06%	14.95%
3.1.2 期末数据	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	

和指标		
期末可供分配利润	3,900,809.89	7,267,395.11
期末可供分配基金份额利润	0.0893	0.0881
期末基金资产净值	50,611,576.12	95,484,829.57
期末基金份额净值	1.1591	1.1579
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	15.91%	15.79%

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。

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

宝盈中证 A500 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	18.14%	1.37%	13.54%	1.34%	4.60%	0.03%
过去六个月	15.06%	1.20%	11.34%	1.22%	3.72%	-0.02%
自基金合同生效起至今	15.91%	1.12%	12.90%	1.17%	3.01%	-0.05%

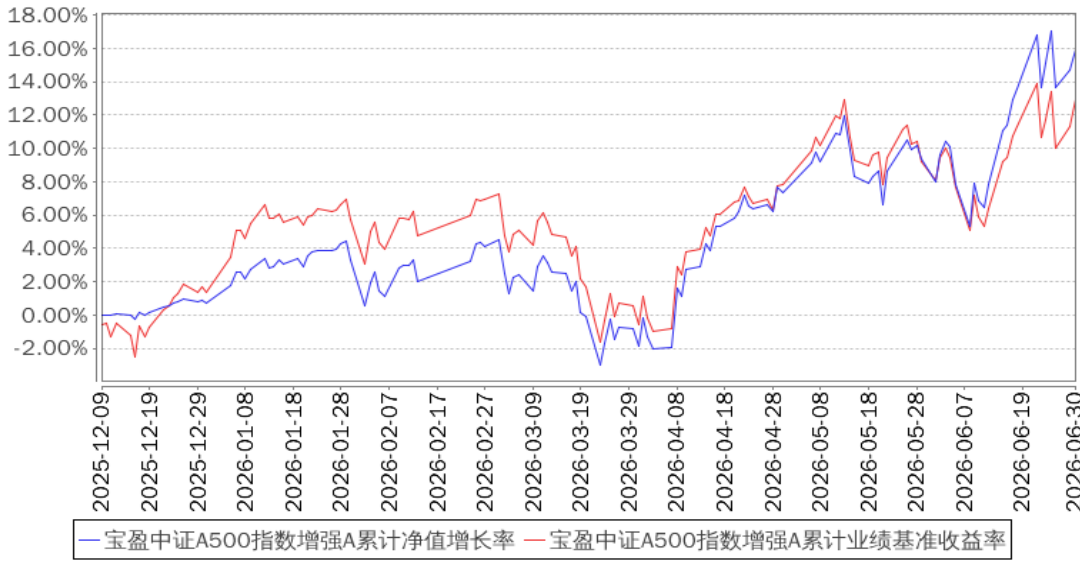
宝盈中证 A500 指数增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	18.09%	1.37%	13.54%	1.34%	4.55%	0.03%

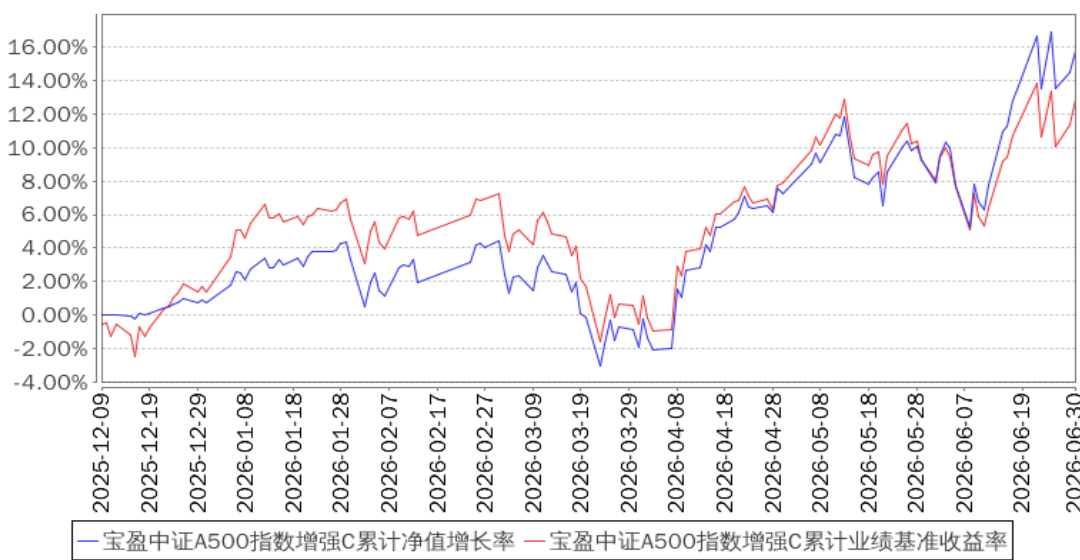
过去六个月	14.95%	1.20%	11.34%	1.22%	3.61%	-0.02%
自基金合同生效起 至今	15.79%	1.12%	12.90%	1.17%	2.89%	-0.05%

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

宝盈中证A500指数增强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



宝盈中证A500指数增强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：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
各项资产配置比例符合基金合同中的相关约定。

§ 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、宝盈祥颐定期开放混合、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		
阳之璇	本基金、宝盈北证 50 成份指数型发起式证券投资基金的基金经理	2026 年 2 月 28 日	-	7 年	阳之璇女士，约翰霍普金斯大学数学与统计学硕士。2018 年 7 月加入宝盈基金管理有限公司，曾任研究员助理、量化研究员、基金经理助理，中国国籍，证券投资基金从业人员资格。
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、	2025 年 12 月 9 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。

	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、宝盈恒生科技指数型证券投资基金 (QDII) 基金经理；量化投资部总经理				
--	--	--	--	--	--

注：1、蔡丹为首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写；

2、阳之璇非首任基金经理，其“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；

3、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 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。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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。

4.3.2 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。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，全球宏观环境呈现“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。国内经济一季度 GDP 同比增长 5.0% 开局良好，但二季度回落至 4.3%，上半年 GDP 合计 69.57 万亿元，同比增长 4.7%，实现了平稳开局，但复苏斜率在一季度冲高后有所放缓。从结构上看，上半年我国集成电路出口按美元计价口径同比暴增 96.1%，出口额创半年度历史新高，芯片超越手机和电脑成为出口头号商品；上半年货物贸易进出口 25.47 万亿元，同比增长 16.9%，出口超高韧性成为人民币升值的核心驱动力之一，制造业投资和出口仍是主要拉动力，而内需消费修复偏弱。

2026 年上半年 A 股市场呈现“跨年冲高—黑天鹅暴跌—修复加速”的陡峭节奏。1-2 月市场延续 2025 年末跨年行情，政策预期与流动性宽松驱动下强势上涨，1 月上证指数一度突破 4190 点创十年新高，AI 应用、商业航天、机器人、贵金属等板块成为资金集中涌入焦点；2 月 28 日美伊军事冲突爆发并在 3 月全面升级，上证指数 3 月累计下跌 6.51%，创逾 4 年来最大单月跌幅，3 月 23 日最低触及 3794.68 点；4 月 8 日美伊进入停战状态，此后转入漫长的和平谈判，市场风险偏好系统性修复，一季报窗口期科技股业绩超预期，成长风格全面反弹；6 月美国对华芯片管制全面升级至覆盖设计、制造、设备、软件的“全链条监管”新阶段，强化了国产替代叙事，成为上半年 A 股科技行情的核心催化剂。上半年末上证指数收于 4094.40 点，上半年上涨 3.16%。

从资金面来看，上半年 A 股市场交投持续活跃。上半年两市总成交额高达 317.53 万亿元，刷新历史同期纪录，一季度日均成交金额达 2.56 万亿，远超上个季度的 1.95 万亿，处于历史最高水平，二季度日均成交进一步攀升至 2.86 万亿，续创季度日均成交历史新高。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 月新任主席沃什首次主持会议即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,“无导航”的政策沟通加剧了市场不确定性,对前期估值处于相对高位的全球成长股形成一定扰动。上半年美元相对人民币贬值 2.92%,上半年末美元兑人民币即期汇率为 6.7852,位于 2015 年以来 45.74% 的分位数。

从市场走势来看,上半年 A 股呈现“科技独舞、K 型分化”的极端结构性行情,科创方向暴涨而大盘指数温和上涨:科创综指上涨 53.99%,创业板指上涨 35.58%,中证 500 上涨 20.97%,中证 1000 上涨 15.99%,中证 A500 上涨 11.91%,中证 800 上涨 11.12%,中证 A100 上涨 8.47%,沪深 300 上涨 7.55%,上证指数上涨 3.16%;而上证 50 下跌 1.38%,中证红利下跌 8.75%,大盘价值下跌 15.04%。分行业来看,中信一级行业仅有 9 个行业上涨,涨幅前三的行业:电子(上涨 85.49%)、通信(上涨 74.54%)和建材(上涨 43.70%);跌幅居前的三个行业:消费者服务(下跌 31.88%)、综合金融(下跌 29.58%)和综合(下跌 25.09%)。

从价值成长风格来看,上半年两风格差距极端化,国证成长上涨 19.18%,国证价值下跌 8.40%,成长风格大幅跑赢价值风格。从规模指数来看,中盘成长表现最好,其中,中盘成长和小盘成长分别上涨 31.02% 和 24.66%,好于大盘成长(上涨 13.76%),而价值风格全面承压,大盘价值表现最弱,下跌 15.04%,小盘价值下跌 4.02%,中盘价值上涨 6.49% 是唯一上涨的价值细分。

在经历上半年 AI 主线大幅上涨后,科技方向估值已处于历史极值水平,而价值板块估值进一步压缩,A 股主要指数估值分化达到极端状态。截至 2026/6/30,科创 50 指数的 PE 高达 258.97 倍,中证 A500 指数的 PE 为 17.93 倍,股息率为 2.31%,历史分位数 65.9%。

本基金致力于挖掘财务数据、一致预期数据、市场行情数据、市场情绪数据中蕴含的有效因子,构建多维度、多策略的选股体系。本基金通过对成份股内部有效因子的挖掘,在实现主要风险因子中性的基础上,严格控制与基准指数的偏离度,通过增强策略来增强产品收益。报告期内,本基金在跟踪中证 A500 指数成份股的基础上,通过多策略方式构建了增强组合。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末宝盈中证 A500 指数增强 A 的基金份额净值为 1.1591 元,本报告期基金份额净值增长率为 15.06%;截至本报告期末宝盈中证 A500 指数增强 C 的基金份额净值为 1.1579 元,本报告期基金份额净值增长率为 14.95%。同期业绩比较基准收益率为 11.34%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

7 月以来 A 股市场波动明显加大,上半年强势的科创板、创业板回调幅度较大,AI 主线极端上涨后的拥挤度风险正在释放,而红利、大盘价值板块逆势修复,市场进入风格再平衡阶段。展望下半年,地缘政治方面,7 月上旬美伊短暂静默协议破裂、冲突再起,后续和谈进展仍是关键变

量；中美关系方面，7 月高端制造关税复审和 8 月对华贸易地位结论是关键观察窗口，参考上半年集成电路出口暴增 96.1%的产业韧性，我们认为“封锁-突围”的博弈逻辑将继续强化国产替代的投资叙事，科技自主可控方向仍具长期配置价值。当前来看，我们认为仍然存在多项有利因素支撑市场稳健运行。一是产业趋势确定性强，国产替代从政策驱动转向业绩驱动，全球半导体销售额同比增速达 93%，AI 产业超级周期仍在加速。二是政策有空间，央行 7 月 15 日明确表示“降准还有空间”，LPR 已连续 14 个月不变，“十五五”规划重大工程也有望在下半年形成实物工作量。三是估值分化提供再平衡空间，价值板块估值已压缩至极端低位，若风格切换，修复空间较大。当前在全球流动性宽裕、国内经济预期改善背景下，中国资产吸引力提升，汇率持续强势有望提供关键流动性及信心支撑，是 A 股上行的重要驱动力。国内无风险收益处于低位，我们认为 A 股有望延续结构性行情，当前来看，价值、红利类资产配置价值凸显。

我们将严格按照基金合同的规定，在严格控制与基准指数偏离的基础上，依托多维度选股策略体系，在控制成分股占比、行业偏离、个股偏离及主要风险因子暴露的前提下，利用组合优化体系来构建增强组合，我们将继续努力尽责地做好本基金的管理工作，尽力为投资者谋取较好的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：宝盈中证 A500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	325,766.39	14,664,542.37
结算备付金		3,255,117.85	4,708,275.92
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	136,751,070.55	135,274,738.65
其中：股票投资		132,709,101.23	128,709,111.80
基金投资		-	-
债券投资		4,041,969.32	6,565,626.85
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	-	99,001,705.71
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		6,281,619.39	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		146,613,574.18	253,649,262.65
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		317,155.66	-
应付管理人报酬		89,604.25	121,745.65
应付托管费		16,800.80	22,827.32
应付销售服务费		14,072.75	18,117.51
应付投资顾问费		-	-
应交税费		147.84	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	79,387.19	876.00
负债合计		517,168.49	163,566.48
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	126,129,545.84	251,647,033.85
未分配利润	6.4.7.11	19,966,859.85	1,838,662.32
净资产合计		146,096,405.69	253,485,696.17
负债和净资产总计		146,613,574.18	253,649,262.65

注： 报告截止日 2026 年 6 月 30 日，宝盈中证 A500 指数增强型证券投资基金 A 类基金份额净值人民币 1.1591 元，A 类基金份额 43,662,932.56 份；C 类基金份额净值人民币 1.1579 元，C 类基金份额 82,466,613.28 份；宝盈中证 A500 指数增强型证券投资基金基金份额总额合计为 126,129,545.84 份。

6.2 利润表

会计主体：宝盈中证 A500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 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 1 日至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		25,699,687.51
1. 利息收入		62,122.30
其中：存款利息收入	6.4.7.12	4,790.16
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		57,332.14
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		13,380,701.64
其中：股票投资收益	6.4.7.13	12,143,398.72
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.14	35,726.60
资产支持证券投资收益	6.4.7.15	-
贵金属投资收益	6.4.7.16	-
衍生工具收益	6.4.7.17	-
股利收益	6.4.7.18	1,201,576.32
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	12,246,524.76
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	10,338.81
减：二、营业总支出		900,061.34
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	617,572.88
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	115,794.91
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	86,007.70
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	6.4.7.21	-
7. 税金及附加		40.13
8. 其他费用	6.4.7.22	80,645.72
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		24,799,626.17
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		24,799,626.17
五、其他综合收益的税后净额		-

六、综合收益总额		24,799,626.17
----------	--	---------------

注：本基金合同生效日为 2025 年 12 月 9 日，无上年度同期对比数。

6.3 净资产变动表

会计主体：宝盈中证 A500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 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	251,647,033.85	-	1,838,662.32	253,485,696.17
二、本期期初净资产	251,647,033.85	-	1,838,662.32	253,485,696.17
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-125,517,488.01	-	18,128,197.53	-107,389,290.48
（一）、综合收益总额	-	-	24,799,626.17	24,799,626.17
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-125,517,488.01	-	-6,671,428.64	-132,188,916.65
其中：1. 基金申购款	81,902,323.75	-	2,100,074.36	84,002,398.11
2. 基金赎回款	-207,419,811.76	-	-8,771,503.00	-216,191,314.76
（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	126,129,545.84	-	19,966,859.85	146,096,405.69

注：本基金合同生效日为 2025 年 12 月 9 日，无上年度同期对比数。

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

张献锦

何瑜

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

宝盈中证 A500 指数增强型证券投资基金(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]267 号《关于准予宝盈中证 A500 指数型证券投资基金注册的批复》和证监许可[2025]2033 号《关于准予宝盈中证 A500 指数型证券投资基金变更注册的批复》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《宝盈中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》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 251,587,614.22 元,业经容诚会计师事务所(特殊普通合伙)容诚验字[2025]200Z0201 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《宝盈中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2025 年 12 月 9 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 251,647,033.85 份基金份额,其中认购资金利息折合 59,419.63 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,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《宝盈中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》和《宝盈中证 A500 指数增强型证券投资基金招募说明书》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《宝盈中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括标的指数成份股、备选成份股、其他国内依法发行上市的股票(包括主板、科创板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证)、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、地方政府债券、政府支持债券、政府支持机构债券、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、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券及其他中国证监会允许基金投资的债券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括定期存款、协议存款及

其他银行存款)、货币市场工具、金融衍生工具(包括股指期货、国债期货、股票期权等)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可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(包括国内依法发行上市的股票、存托凭证、港股通标的股票)的比例不低于基金资产的 80%,投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%,投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。每个交易日日终,在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计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中证 A500 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率(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》、《宝盈中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》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。

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 1 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 1 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。

6.4.4.4 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、债券投资和资产支持证券投资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)。

6.4.4.9 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。

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 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(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

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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[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]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》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

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

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

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

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。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	325,766.39

等于：本金	325,688.54
加：应计利息	77.85
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	325,766.39

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		118,619,980.32	-	132,709,101.23	14,089,120.91
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	4,004,840.00	39,169.32	4,041,969.32	-2,040.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	4,004,840.00	39,169.32	4,041,969.32	-2,040.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		122,624,820.32	39,169.32	136,751,070.55	14,087,080.91

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	0.79
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	77,359.40
其他应付款	2,027.00
合计	79,387.19

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

宝盈中证 A500 指数增强 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	101,848,611.69	101,848,611.69
本期申购	4,686,089.32	4,686,089.32
本期赎回（以“-”号填列）	-62,871,768.45	-62,871,768.45
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	43,662,932.56	43,662,932.56

宝盈中证 A500 指数增强 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	149,798,422.16	149,798,422.16
本期申购	77,216,234.43	77,216,234.43
本期赎回（以“-”号填列）	-144,548,043.31	-144,548,043.31
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	82,466,613.28	82,466,613.28

6.4.7.11 未分配利润

单位：人民币元

宝盈中证 A500 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,566.37	744,951.44	751,517.81
本期期初	6,566.37	744,951.44	751,517.81
本期利润	5,649,377.17	3,343,493.97	8,992,871.14
本期基金份额交易产生的变动数	-1,755,133.65	-1,040,611.74	-2,795,745.39
其中：基金申购款	180,781.45	82,228.49	263,009.94

基金赎回款	-1,935,915.10	-1,122,840.23	-3,058,755.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,900,809.89	3,047,833.67	6,948,643.56

宝盈中证 A500 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-8,460.20	1,095,604.71	1,087,144.51
本期期初	-8,460.20	1,095,604.71	1,087,144.51
本期利润	6,903,724.24	8,903,030.79	15,806,755.03
本期基金份额交易产生的变动数	372,131.07	-4,247,814.32	-3,875,683.25
其中：基金申购款	3,597,107.38	-1,760,042.96	1,837,064.42
基金赎回款	-3,224,976.31	-2,487,771.36	-5,712,747.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,267,395.11	5,750,821.18	13,018,216.29

6.4.7.12 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	3,873.95
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	916.21
其他	-
合计	4,790.16

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1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	12,143,398.72
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	12,143,398.72

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 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	288,409,394.97
减：卖出股票成本总额	275,977,253.89

减：交易费用	288,742.36
买卖股票差价收入	12,143,398.72

6.4.7.13.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	35,406.43
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	320.17
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	35,726.60

6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	6,587,983.98
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	6,499,735.00
减：应计利息总额	87,923.98
减：交易费用	4.83
买卖债券差价收入	320.17

6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.15 资产支持证券投资收益

6.4.7.15.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.15.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.15.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 贵金属投资收益

6.4.7.16.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.16.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 衍生工具收益

6.4.7.17.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.17.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.18 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,201,576.32
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	1,201,576.32

6.4.7.19 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	12,246,524.76
股票投资	12,250,779.76
债券投资	-4,255.00
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	12,246,524.76

6.4.7.20 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	10,338.81
合计	10,338.81

6.4.7.21 信用减值损失

无。

6.4.7.22 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	17,852.03
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	3,286.32
合计	80,645.72

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

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金销售机构

中铁信托有限责任公司（“中铁信托”）	基金管理人的股东
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 权证交易

无。

6.4.10.1.5 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 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	617,572.88
其中：应支付销售机构的客户维护费	276,325.16
应支付基金管理人的净管理费	341,247.72

注：1、支付基金管理人宝盈基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.80%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×0.80%/当年天数。

2、本基金合同生效日为 2025 年 12 月 09 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 1 日至 2026 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

当期发生的基金应支付的托管费	115,794.91
----------------	------------

注：1、支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

2、本基金合同生效日为 2025 年 12 月 09 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 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	宝盈中证 A500 指数增 强 A	宝盈中证 A500 指数增 强 C	合计
宝盈基金	-	629.46	629.46
招商银行	-	11,580.92	11,580.92
合计	-	12,210.38	12,210.38

注：1、支付基金销售机构的销售服务费按前一日本基金 C 类份额的基金资产净值 0.2%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=前一日本基金 C 类份额的基金资产净值×0.2%/当年天数。

2、本基金合同生效日为 2025 年 12 月 09 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 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	325,766.39	3,873.95

注：1、本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

2、本基金合同生效日为 2025 年 12 月 09 日，无上年可比期间数据。

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	53.26	58.74	73	3,887.98	4,288.02	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	6 个月	新股流通受限	10.11	10.11	4,671	47,223.81	47,223.81	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新股流通受限	10.11	10.11	2,001	20,230.11	20,230.11	-

001365	天海电子	2026年5月11日	6个月	新股流通受限	27.19	31.31	180	4,894.20	5,635.80	-
001393	维通利	2026年5月8日	6个月	新股流通受限	30.38	38.99	126	3,827.88	4,912.74	-
001399	惠科股份	2026年6月16日	6个月	新股流通受限	10.12	27.73	805	8,146.60	22,322.65	-
301669	高特电子	2026年6月2日	6个月	新股流通受限	7.08	28.40	306	2,166.48	8,690.40	-
603293	埃泰克	2026年4月9日	6个月	新股流通受限	33.49	33.93	30	1,004.70	1,017.90	-
603407	长裕集团	2026年4月29日	6个月	新股流通受限	13.86	73.46	119	1,649.34	8,741.74	-
603435	嘉德利	2026年5月15日	6个月	新股流通受限	15.76	46.71	80	1,260.80	3,736.80	-
603459	红板科技	2026年3月31日	6个月	新股流通受限	17.70	84.32	109	1,929.30	9,190.88	-
688635	长进光子	2026年5月20日	6个月	新股流通受限	40.98	308.19	71	2,909.58	21,881.49	-
688781	视涯科技	2026年3月18日	6个月	新股流通受限	22.68	47.61	256	5,806.08	12,188.16	-
688797	臻宝科技	2026年6月16日	6个月	新股流通受限	44.56	468.67	60	2,673.60	28,120.20	-

688808	联讯仪器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新股流通受限	81.88	1,584.33	44	3,602.72	69,710.52	-
688811	有研新材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新股流通受限	6.41	24.13	510	3,269.10	12,306.30	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	239	4,703.52	33,816.11	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

3、基金作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	832.00	2026 年 7 月 13 日	890.99	800	350,398.57	665,600.00	-

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

本基金为指数型基金，属于证券投资基金中的较高风险较高收益品种，本基金的风险与预期收益都要高于混合型基金、债券基金和货币市场基金。本基金的主要投资对象是具有良好的流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、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。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目标。

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的托管人招商银行，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	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	4,041,969.32	-
合计	4,041,969.32	-

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、流通受限制的投资品

种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司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、结算

备付金、存出保证金和债券投资等。

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	325,766.39	-	-	-	325,766.39
结算备付金	3,255,117.85	-	-	-	3,255,117.85
交易性金融资产	4,041,969.32	-	-	132,709,101.23	136,751,070.55
应收申购款	-	-	-	6,281,619.39	6,281,619.39
资产总计	7,622,853.56	-	-	138,990,720.62	146,613,574.18
负债					
应付赎回款	-	-	-	317,155.66	317,155.66
应付管理人报酬	-	-	-	89,604.25	89,604.25
应付托管费	-	-	-	16,800.80	16,800.80
应付销售服务费	-	-	-	14,072.75	14,072.75
应交税费	-	-	-	147.84	147.84
其他负债	-	-	-	79,387.19	79,387.19
负债总计	-	-	-	517,168.49	517,168.49
利率敏感度缺口	7,622,853.56	-	-	138,473,552.13	146,096,405.69
上年度末 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	14,664,542.37	-	-	-	14,664,542.37
结算备付金	4,708,275.92	-	-	-	4,708,275.92
交易性金融资产	6,565,626.85	-	-	128,709,111.80	135,274,738.65
买入返售金融资产	99,001,705.71	-	-	-	99,001,705.71
资产总计	124,940,150.85	-	-	128,709,111.80	253,649,262.65
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	121,745.65	121,745.65
应付托管费	-	-	-	22,827.32	22,827.32
应付销售服务费	-	-	-	18,117.51	18,117.51
其他负债	-	-	-	876.00	876.00
负债总计	-	-	-	163,566.48	163,566.48
利率敏感度缺口	124,940,150.85	-	-	128,545,545.32	253,485,696.17

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 2.77%(2025 年 12 月 31 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 2.59%)，

因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2025 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

无。

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，按照成份股在中证 500 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。本基金对主动投资部分实行双向积极配置策略。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

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%的基金资产投资于中证 500 指数成份股和备选成分股，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		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	132,709,101.23	90.84	128,709,111.80	50.78
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	132,709,101.23	90.84	128,709,111.80	50.78

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 A500 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）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
分析	1. 中证 A500 指数收益率上升 5%	6,764,814.21	－
－	2. 中证 A500 指数收益率下降 5%	－6,764,814.21	－

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	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	131,729,487.60	128,183,576.80
第二层次	4,775,023.24	7,091,161.85
第三层次	246,559.71	－

合计	136,751,070.55	135,274,738.65
----	----------------	----------------

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。 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会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将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。
--

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 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(2025 年 12 月 31 日：同)。
--

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

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	132,709,101.23	90.52
	其中：股票	132,709,101.23	90.52
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,041,969.32	2.76
	其中：债券	4,041,969.32	2.76
	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	3,580,884.24	2.44
8	其他各项资产	6,281,619.39	4.28
9	合计	146,613,574.18	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	108,469.00	0.07
B	采矿业	5,579,552.00	3.82
C	制造业	83,237,326.50	56.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,381,064.00	1.63
E	建筑业	1,132,046.00	0.77
F	批发和零售业	2,355,494.00	1.61
G	交通运输、仓储和邮政业	3,033,821.00	2.08
H	住宿和餐饮业	103,047.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,080,801.70	4.16
J	金融业	11,852,169.00	8.11
K	房地产业	653,567.00	0.45
L	租赁和商务服务业	491,037.00	0.34
M	科学研究和技术服务业	1,641,166.00	1.12
N	水利、环境和公共设施管理业	781,901.00	0.54
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	67,760.00	0.05
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	36,938.00	0.03
	合计	119,536,159.20	81.82

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	315,779.00	0.22
C	制造业	10,660,210.91	7.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	68,343.92	0.05
E	建筑业	435,232.00	0.30
F	批发和零售业	379,067.20	0.26
G	交通运输、仓储和邮政业	2,727.00	0.00

H	住宿和餐饮业	1,833.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	253,027.00	0.17
J	金融业	644,603.00	0.44
K	房地产业	14,350.00	0.01
L	租赁和商务服务业	1,330.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	6,124.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	382,080.00	0.26
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	3,435.00	0.00
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	4,800.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	13,172,942.03	9.02

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	4,800	6,096,000.00	4.17
2	300750	宁德时代	11,400	4,480,314.00	3.07
3	300502	新易盛	5,360	3,253,520.00	2.23
4	603986	兆易创新	3,600	2,934,000.00	2.01
5	600519	贵州茅台	2,400	2,845,176.00	1.95
6	601318	中国平安	44,100	2,105,334.00	1.44
7	601899	紫金矿业	79,600	2,001,144.00	1.37
8	002384	东山精密	7,000	1,836,450.00	1.26
9	688256	寒武纪	1,094	1,745,531.70	1.19
10	600900	长江电力	63,400	1,678,198.00	1.15
11	000333	美的集团	21,600	1,631,448.00	1.12
12	600030	中信证券	55,600	1,597,388.00	1.09
13	601398	工商银行	218,800	1,546,916.00	1.06
14	688498	源杰科技	800	1,508,800.00	1.03
15	600183	生益科技	8,700	1,508,580.00	1.03
16	600487	亨通光电	13,300	1,454,222.00	1.00
17	603259	药明康德	11,600	1,444,316.00	0.99

18	300408	三环集团	8,500	1,418,650.00	0.97
19	688525	佰维存储	2,800	1,385,244.00	0.95
20	601288	农业银行	222,100	1,348,147.00	0.92
21	002463	沪电股份	8,500	1,298,800.00	0.89
22	600522	中天科技	20,800	1,262,144.00	0.86
23	301308	江波龙	1,700	1,196,460.00	0.82
24	601166	兴业银行	70,400	1,165,824.00	0.80
25	600176	中国巨石	15,700	1,144,216.00	0.78
26	300857	协创数据	3,160	1,074,084.00	0.74
27	002475	立讯精密	14,300	1,006,720.00	0.69
28	603993	洛阳钼业	57,100	1,002,105.00	0.69
29	600150	中国船舶	29,210	987,005.90	0.68
30	002415	海康威视	28,300	967,860.00	0.66
31	002916	深南电路	2,100	961,590.00	0.66
32	000657	中钨高新	9,800	938,056.00	0.64
33	000651	格力电器	24,800	930,000.00	0.64
34	000338	潍柴动力	33,100	901,975.00	0.62
35	002371	北方华创	1,000	884,560.00	0.61
36	688008	澜起科技	2,800	867,720.00	0.59
37	600309	万华化学	12,500	855,125.00	0.59
38	300475	香农芯创	2,800	840,000.00	0.57
39	688012	中微公司	1,792	839,552.00	0.57
40	300014	亿纬锂能	12,700	825,881.00	0.57
41	688041	海光信息	2,200	814,660.00	0.56
42	688981	中芯国际	4,800	762,336.00	0.52
43	600887	伊利股份	31,700	759,532.00	0.52
44	300223	北京君正	3,000	746,700.00	0.51
45	688002	睿创微纳	4,800	742,512.00	0.51
46	601872	招商轮船	39,400	692,258.00	0.47
47	601816	京沪高铁	152,200	689,466.00	0.47
48	688072	拓荆科技	800	665,600.00	0.46
49	601988	中国银行	109,200	624,624.00	0.43
50	688396	华润微	6,400	624,320.00	0.43
51	002202	金风科技	26,100	623,790.00	0.43
52	601658	邮储银行	125,300	617,729.00	0.42
53	605117	德业股份	5,660	600,978.80	0.41
54	002558	巨人网络	21,700	598,052.00	0.41
55	000408	藏格矿业	8,600	596,152.00	0.41
56	601601	中国太保	20,800	593,216.00	0.41
57	688266	泽璟制药	5,000	583,300.00	0.40
58	300059	东方财富	28,200	574,716.00	0.39
59	300438	鹏辉能源	6,900	571,665.00	0.39
60	688111	金山办公	2,600	553,930.00	0.38

61	600489	中金黄金	30,300	546,915.00	0.37
62	300274	阳光电源	3,400	540,668.00	0.37
63	000988	华工科技	2,900	535,369.00	0.37
64	000725	京东方 A	61,000	529,480.00	0.36
65	002414	高德红外	39,600	525,096.00	0.36
66	601328	交通银行	80,000	514,400.00	0.35
67	000938	紫光股份	17,800	513,708.00	0.35
68	600104	上汽集团	52,600	513,376.00	0.35
69	600549	厦门钨业	6,000	511,200.00	0.35
70	600026	中远海能	28,100	504,114.00	0.35
71	002594	比亚迪	6,300	502,110.00	0.34
72	000001	平安银行	49,900	501,495.00	0.34
73	002008	大族激光	3,300	495,363.00	0.34
74	002266	浙富控股	95,800	484,748.00	0.33
75	601877	正泰电器	19,200	481,344.00	0.33
76	600276	恒瑞医药	9,200	478,768.00	0.33
77	300604	长川科技	1,400	477,988.00	0.33
78	601607	上海医药	30,200	465,080.00	0.32
79	000301	东方盛虹	40,100	459,145.00	0.31
80	000426	兴业银锡	13,900	458,144.00	0.31
81	688578	艾力斯	4,152	453,398.40	0.31
82	601088	中国神华	11,400	445,056.00	0.30
83	000933	神火股份	20,600	436,720.00	0.30
84	300476	胜宏科技	1,200	415,716.00	0.28
85	600989	宝丰能源	19,400	394,402.00	0.27
86	002493	荣盛石化	35,900	385,925.00	0.26
87	600570	恒生电子	18,200	385,658.00	0.26
88	300394	天孚通信	1,260	381,376.80	0.26
89	000807	云铝股份	17,200	380,808.00	0.26
90	301358	湖南裕能	5,000	379,350.00	0.26
91	002517	恺英网络	23,300	378,625.00	0.26
92	600196	复星医药	16,800	377,496.00	0.26
93	601117	中国化学	51,200	376,320.00	0.26
94	603659	璞泰来	12,900	373,197.00	0.26
95	688521	芯原股份	1,000	371,140.00	0.25
96	000519	中兵红箭	17,600	370,832.00	0.25
97	600941	中国移动	4,300	370,359.00	0.25
98	600372	中航机载	34,000	368,900.00	0.25
99	600362	江西铜业	8,200	355,060.00	0.24
100	601360	三六零	40,800	354,552.00	0.24
101	600741	华域汽车	22,600	350,752.00	0.24
102	002709	天赐材料	6,800	349,724.00	0.24
103	300395	菲利华	2,600	347,698.00	0.24

104	000858	五 粮 液	4,400	325,600.00	0.22
105	600511	国药股份	12,300	320,292.00	0.22
106	300919	中伟新材	7,200	315,000.00	0.22
107	002128	电投能源	13,000	300,560.00	0.21
108	300124	汇川技术	4,300	285,219.00	0.20
109	600663	陆家嘴	45,200	283,856.00	0.19
110	300972	万辰集团	1,600	277,456.00	0.19
111	000100	TCL 科技	46,300	269,466.00	0.18
112	601211	国泰海通	14,800	269,360.00	0.18
113	688347	华虹宏力	800	269,040.00	0.18
114	600019	宝钢股份	49,000	266,070.00	0.18
115	601111	中国国航	43,100	260,755.00	0.18
116	300760	迈瑞医疗	1,900	258,077.00	0.18
117	600066	宇通客车	9,600	257,376.00	0.18
118	002281	光迅科技	1,000	256,940.00	0.18
119	601888	中国中免	4,700	252,437.00	0.17
120	603939	益丰药房	13,900	249,922.00	0.17
121	002236	大华股份	14,900	245,701.00	0.17
122	600875	东方电气	8,200	235,914.00	0.16
123	600803	新奥股份	14,300	225,940.00	0.15
124	600028	中国石化	49,900	222,554.00	0.15
125	600089	特变电工	9,800	220,500.00	0.15
126	002028	思源电气	1,200	207,600.00	0.14
127	300454	深信服	2,100	202,020.00	0.14
128	600000	浦发银行	23,100	198,891.00	0.14
129	002156	通富微电	2,600	197,262.00	0.14
130	300346	南大光电	2,100	194,565.00	0.13
131	000538	云南白药	4,100	194,217.00	0.13
132	603019	中科曙光	1,800	193,014.00	0.13
133	601006	大秦铁路	41,700	192,237.00	0.13
134	300567	精测电子	600	190,560.00	0.13
135	600323	瀚蓝环境	6,900	189,474.00	0.13
136	601668	中国建筑	43,100	187,054.00	0.13
137	600460	士兰微	3,400	185,844.00	0.13
138	300757	罗博特科	300	185,700.00	0.13
139	600535	天士力	13,700	181,251.00	0.12
140	600584	长电科技	1,700	176,035.00	0.12
141	601233	桐昆股份	8,100	175,365.00	0.12
142	601238	广汽集团	34,400	174,752.00	0.12
143	601225	陕西煤业	8,400	170,940.00	0.12
144	002602	世纪华通	11,900	167,790.00	0.11
145	603799	华友钴业	3,400	164,084.00	0.11
146	002049	紫光国微	1,800	159,750.00	0.11

147	300458	全志科技	4,000	157,840.00	0.11
148	300661	圣邦股份	1,100	157,828.00	0.11
149	002407	多氟多	3,000	150,690.00	0.10
150	600111	北方稀土	3,100	148,955.00	0.10
151	300037	新宙邦	1,600	148,560.00	0.10
152	300033	同花顺	600	144,600.00	0.10
153	000063	中兴通讯	3,900	141,141.00	0.10
154	601100	恒立液压	1,300	139,828.00	0.10
155	600029	南方航空	26,900	139,342.00	0.10
156	601857	中国石油	15,700	136,276.00	0.09
157	000625	长安汽车	18,900	135,513.00	0.09
158	300474	景嘉微	2,200	133,056.00	0.09
159	601800	中国交建	23,200	132,472.00	0.09
160	003816	中国广核	32,900	128,639.00	0.09
161	600885	宏发股份	3,600	124,164.00	0.08
162	000960	锡业股份	2,900	123,801.00	0.08
163	002001	新 和 成	4,300	122,206.00	0.08
164	601168	西部矿业	4,500	122,130.00	0.08
165	600170	上海建工	55,000	122,100.00	0.08
166	688599	天合光能	8,600	121,432.00	0.08
167	688009	中国通号	25,400	120,904.00	0.08
168	300136	信维通信	1,000	119,250.00	0.08
169	002738	中矿资源	2,000	117,980.00	0.08
170	688506	百利天恒	400	117,612.00	0.08
171	600031	三一重工	6,800	117,504.00	0.08
172	600938	中国海油	4,300	116,745.00	0.08
173	002812	恩捷股份	1,700	113,747.00	0.08
174	603899	晨光股份	5,500	113,465.00	0.08
175	001979	招商蛇口	17,200	110,596.00	0.08
176	002648	卫星化学	4,700	110,403.00	0.08
177	300450	先导智能	2,700	109,944.00	0.08
178	002459	晶澳科技	13,500	109,350.00	0.07
179	002714	牧原股份	3,100	108,469.00	0.07
180	600064	南京高科	15,200	108,376.00	0.07
181	601633	长城汽车	7,100	107,139.00	0.07
182	000157	中联重科	15,200	105,944.00	0.07
183	688331	荣昌生物	800	104,208.00	0.07
184	600352	浙江龙盛	8,600	104,146.00	0.07
185	300339	润和软件	2,700	103,977.00	0.07
186	600886	国投电力	7,800	103,818.00	0.07
187	600406	国电南瑞	4,500	102,825.00	0.07
188	600482	中国动力	3,100	101,680.00	0.07
189	002340	格林美	15,300	101,133.00	0.07

190	002050	三花智控	2,300	100,809.00	0.07
191	600418	江淮汽车	3,900	100,737.00	0.07
192	600426	华鲁恒升	4,200	100,464.00	0.07
193	002273	水晶光电	2,800	99,344.00	0.07
194	300759	康龙化成	3,400	98,362.00	0.07
195	002555	三七互娱	5,200	98,124.00	0.07
196	601186	中国铁建	16,300	96,985.00	0.07
197	002532	天山铝业	8,800	94,424.00	0.06
198	600516	方大炭素	15,000	92,550.00	0.06
199	300012	华测检测	6,600	91,476.00	0.06
200	300433	蓝思科技	1,700	91,222.00	0.06
201	300558	贝达药业	1,400	91,098.00	0.06
202	300142	沃森生物	7,000	90,930.00	0.06
203	688120	华海清科	280	90,210.40	0.06
204	601919	中远海控	6,700	88,842.00	0.06
205	601728	中国电信	17,100	88,749.00	0.06
206	600233	圆通速递	5,600	88,200.00	0.06
207	601021	春秋航空	1,900	86,602.00	0.06
208	300496	中科创达	1,400	86,506.00	0.06
209	002230	科大讯飞	2,100	85,764.00	0.06
210	600660	福耀玻璃	1,700	85,748.00	0.06
211	000623	吉林敖东	4,800	85,104.00	0.06
212	000733	振华科技	1,500	84,960.00	0.06
213	002465	海格通信	6,600	84,282.00	0.06
214	300866	安克创新	800	83,600.00	0.06
215	603288	海天味业	2,500	82,900.00	0.06
216	002271	东方雨虹	6,900	81,903.00	0.06
217	300073	当升科技	1,700	81,668.00	0.06
218	000423	东阿阿胶	1,800	81,648.00	0.06
219	002064	华峰化学	8,600	81,614.00	0.06
220	002080	中材科技	900	81,000.00	0.06
221	300432	富临精工	4,000	80,360.00	0.06
222	300699	光威复材	2,800	80,220.00	0.05
223	603606	东方电缆	1,920	79,699.20	0.05
224	002497	雅化集团	3,900	79,443.00	0.05
225	601012	隆基绿能	6,000	78,720.00	0.05
226	601618	中国中冶	32,200	78,568.00	0.05
227	002352	顺丰控股	2,500	78,150.00	0.05
228	000415	渤海租赁	19,100	77,737.00	0.05
229	603129	春风动力	300	76,740.00	0.05
230	600521	华海药业	5,300	76,320.00	0.05
231	002353	杰瑞股份	500	76,250.00	0.05
232	688169	石头科技	800	75,976.00	0.05

233	603501	豪威集团	800	75,880.00	0.05
234	002756	永兴材料	1,300	73,632.00	0.05
235	002065	东华软件	10,300	73,542.00	0.05
236	002603	以岭药业	4,900	73,500.00	0.05
237	601000	唐山港	17,700	73,455.00	0.05
238	600166	福田汽车	24,900	72,459.00	0.05
239	600765	中航重机	5,600	72,352.00	0.05
240	600332	白云山	3,600	72,144.00	0.05
241	002460	赣锋锂业	1,100	71,940.00	0.05
242	600499	科达制造	5,200	71,760.00	0.05
243	601600	中国铝业	8,700	71,514.00	0.05
244	600690	海尔智家	3,500	71,435.00	0.05
245	000683	博源化工	12,300	70,848.00	0.05
246	688036	传音控股	1,200	70,740.00	0.05
247	600998	九州通	15,000	70,350.00	0.05
248	600008	首创环保	25,700	69,904.00	0.05
249	002085	万丰奥威	6,300	69,867.00	0.05
250	600839	四川长虹	10,000	69,800.00	0.05
251	002389	航天彩虹	3,900	69,303.00	0.05
252	600820	隧道股份	13,200	68,772.00	0.05
253	000425	徐工机械	8,500	68,765.00	0.05
254	002410	广联达	8,400	68,544.00	0.05
255	601018	宁波港	21,700	68,355.00	0.05
256	600038	中直股份	2,700	68,283.00	0.05
257	600763	通策医疗	2,000	67,760.00	0.05
258	600704	物产中大	14,300	67,496.00	0.05
259	300832	新产业	1,600	67,200.00	0.05
260	600316	洪都航空	2,400	67,056.00	0.05
261	002851	麦格米特	400	66,872.00	0.05
262	000630	铜陵有色	10,500	66,780.00	0.05
263	688390	固德威	600	65,106.00	0.04
264	600153	建发股份	8,200	65,026.00	0.04
265	601985	中国核电	7,100	64,113.00	0.04
266	000977	浪潮信息	900	63,000.00	0.04
267	600346	恒力石化	3,500	61,985.00	0.04
268	600312	平高电气	3,500	61,810.00	0.04
269	603816	顾家家居	2,700	60,372.00	0.04
270	300601	康泰生物	5,300	60,102.00	0.04
271	002120	韵达股份	9,400	59,784.00	0.04
272	600754	锦江酒店	3,300	59,367.00	0.04
273	002244	滨江集团	7,700	58,520.00	0.04
274	601155	新城控股	5,700	58,482.00	0.04
275	600157	永泰能源	36,300	58,443.00	0.04

276	688472	阿特斯	5,400	58,428.00	0.04
277	300442	润泽科技	700	58,149.00	0.04
278	601766	中国中车	10,900	56,680.00	0.04
279	002436	兴森科技	1,100	56,045.00	0.04
280	600050	中国联通	14,000	56,000.00	0.04
281	603486	科沃斯	1,100	55,825.00	0.04
282	002466	天齐锂业	900	55,188.00	0.04
283	300070	碧水源	17,100	54,549.00	0.04
284	688063	派能科技	1,000	53,270.00	0.04
285	000035	中国天楹	11,000	53,130.00	0.04
286	002938	鹏鼎控股	500	52,690.00	0.04
287	002241	歌尔股份	2,300	51,819.00	0.04
288	688188	柏楚电子	480	51,216.00	0.04
289	300457	赢合科技	2,300	48,484.00	0.03
290	600655	豫园股份	11,300	46,443.00	0.03
291	002027	分众传媒	9,400	45,496.00	0.03
292	002292	奥飞娱乐	6,800	44,608.00	0.03
293	600905	三峡能源	12,000	44,520.00	0.03
294	600588	用友网络	4,800	44,064.00	0.03
295	002837	英维克	550	43,758.00	0.03
296	600258	首旅酒店	4,000	43,680.00	0.03
297	601127	赛力斯	700	42,875.00	0.03
298	601628	中国人寿	1,200	42,420.00	0.03
299	300054	鼎龙股份	400	42,388.00	0.03
300	000032	深桑达 A	1,600	39,920.00	0.03
301	300058	蓝色光标	2,900	39,904.00	0.03
302	000568	泸州老窖	500	38,760.00	0.03
303	600398	海澜之家	7,300	38,179.00	0.03
304	600673	东阳光	1,100	36,938.00	0.03
305	600010	包钢股份	16,500	36,795.00	0.03
306	002625	光启技术	1,200	36,384.00	0.02
307	688617	惠泰医疗	200	36,312.00	0.02
308	600879	航天电子	1,700	36,193.00	0.02
309	601058	赛轮轮胎	3,100	35,743.00	0.02
310	002185	华天科技	1,600	35,696.00	0.02
311	600893	航发动力	900	34,506.00	0.02
312	601689	拓普集团	600	33,852.00	0.02
313	600988	赤峰黄金	1,200	31,584.00	0.02
314	002600	领益智造	1,800	31,212.00	0.02
315	600699	均胜电子	1,400	30,254.00	0.02
316	000069	华侨城 A	18,300	30,012.00	0.02
317	601727	上海电气	4,200	29,400.00	0.02
318	600177	雅戈尔	3,900	29,367.00	0.02

319	600585	海螺水泥	1,700	28,815.00	0.02
320	300390	天华新能	300	28,053.00	0.02
321	601799	星宇股份	300	27,186.00	0.02
322	601669	中国电建	5,500	25,850.00	0.02
323	600547	山东黄金	1,100	25,399.00	0.02
324	688777	中控技术	200	23,500.00	0.02
325	688271	联影医疗	200	20,246.00	0.01
326	600760	中航沈飞	300	12,330.00	0.01
327	600118	中国卫星	100	8,205.00	0.01
328	688126	沪硅产业	200	7,978.00	0.01
329	000034	神州数码	280	7,770.00	0.01
330	002138	顺络电子	100	7,310.00	0.01
331	600415	小商品城	700	7,112.00	0.00
332	300676	华大基因	200	7,012.00	0.00
333	688303	大全能源	400	6,972.00	0.00
334	601677	明泰铝业	400	6,640.00	0.00
335	000617	中油资本	1,000	6,590.00	0.00
336	002294	信立泰	200	6,378.00	0.00
337	605589	圣泉集团	100	6,357.00	0.00
338	600011	华能国际	800	6,072.00	0.00
339	000963	华东医药	200	5,624.00	0.00
340	000932	华菱钢铁	1,600	5,552.00	0.00
341	000831	中国稀土	100	5,549.00	0.00
342	002891	中宠股份	200	5,344.00	0.00
343	600160	巨化股份	100	5,301.00	0.00
344	002091	江苏国泰	700	5,061.00	0.00
345	600009	上海机场	200	4,620.00	0.00
346	600219	南山铝业	1,100	4,389.00	0.00
347	002252	上海莱士	1,000	4,340.00	0.00
348	301236	软通动力	100	4,245.00	0.00
349	600115	中国东航	1,100	4,191.00	0.00
350	002472	双环传动	100	4,151.00	0.00
351	300418	昆仑万维	100	4,036.00	0.00
352	601868	中国能建	1,500	4,005.00	0.00
353	300017	网宿科技	300	3,903.00	0.00
354	600895	张江高科	100	3,725.00	0.00
355	601880	辽港股份	2,500	3,450.00	0.00
356	002131	利欧股份	700	3,325.00	0.00
357	002444	巨星科技	100	3,110.00	0.00
358	300748	金力永磁	100	3,085.00	0.00
359	600392	盛和资源	100	2,977.00	0.00
360	002074	国轩高科	100	2,751.00	0.00
361	600085	同仁堂	100	2,311.00	0.00

362	000400	许继电气	100	2,170.00	0.00
363	300024	机器人	100	1,933.00	0.00
364	000547	航天发展	100	1,915.00	0.00
365	002130	沃尔核材	100	1,896.00	0.00
366	300568	星源材质	100	1,872.00	0.00
367	600862	中航高科	100	1,803.00	0.00
368	601216	君正集团	400	1,784.00	0.00
369	601567	三星电气	100	1,494.00	0.00
370	600674	川投能源	100	1,417.00	0.00
371	300118	东方日升	100	1,245.00	0.00
372	002176	江特电机	100	1,001.00	0.00
373	002572	索菲亚	100	730.00	0.00
374	600864	哈投股份	100	519.00	0.00

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	301536	星辰科技	4,500	579,195.00	0.40
2	001309	德明利	600	565,740.00	0.39
3	301377	鼎泰高科	1,000	550,900.00	0.38
4	688110	东芯股份	2,600	529,620.00	0.36
5	601869	长飞光纤	900	491,310.00	0.34
6	603256	宏和科技	1,800	477,594.00	0.33
7	002653	海思科	7,100	471,014.00	0.32
8	301200	大族数控	1,300	468,845.00	0.32
9	001389	广合科技	1,900	450,775.00	0.31
10	603929	亚翔集成	1,600	435,232.00	0.30
11	688059	华锐精密	2,000	399,420.00	0.27
12	601995	中金公司	11,000	397,650.00	0.27
13	603638	艾迪精密	16,300	382,235.00	0.26
14	603588	高能环境	19,900	382,080.00	0.26
15	601138	工业富联	5,000	360,750.00	0.25
16	688257	新锐股份	3,520	358,688.00	0.25
17	301217	铜冠铜箔	2,100	346,647.00	0.24
18	600685	中船防务	13,100	333,264.00	0.23
19	688308	欧科亿	1,600	290,896.00	0.20
20	603268	松发股份	1,800	250,704.00	0.17
21	300590	移为通信	16,600	238,210.00	0.16
22	600600	青岛啤酒	3,900	203,697.00	0.14
23	603013	亚普股份	12,600	198,954.00	0.14
24	600188	兖矿能源	10,900	193,693.00	0.13
25	000729	燕京啤酒	18,900	191,457.00	0.13
26	002487	大金重工	3,200	185,504.00	0.13
27	603991	领先股份	1,200	169,380.00	0.12

28	003031	中瓷电子	900	162,270.00	0.11
29	600037	歌华有线	25,200	158,004.00	0.11
30	688766	普冉股份	200	153,320.00	0.10
31	601882	海天精工	5,900	119,357.00	0.08
32	603132	金徽股份	7,300	113,734.00	0.08
33	601968	宝钢包装	29,000	113,680.00	0.08
34	600329	达仁堂	3,000	111,660.00	0.08
35	600827	百联股份	14,900	110,409.00	0.08
36	603057	紫燕食品	4,800	107,040.00	0.07
37	688349	三一重能	7,040	106,867.20	0.07
38	301371	敷尔佳	4,000	104,000.00	0.07
39	300953	震裕科技	760	101,612.00	0.07
40	600801	华新建材	6,300	98,280.00	0.07
41	688127	蓝特光学	1,000	97,600.00	0.07
42	300999	金龙鱼	4,100	95,366.00	0.07
43	603195	公牛集团	2,400	93,960.00	0.06
44	601061	中信金属	8,400	90,468.00	0.06
45	600132	重庆啤酒	2,100	86,730.00	0.06
46	300650	太龙股份	5,500	79,915.00	0.05
47	000800	一汽解放	13,200	78,540.00	0.05
48	300592	华凯易佰	4,400	77,880.00	0.05
49	601163	三角轮胎	5,600	71,064.00	0.05
50	688808	联讯仪器	44	69,710.52	0.05
51	600927	永安期货	5,500	68,475.00	0.05
52	003010	若羽臣	2,800	68,040.00	0.05
53	001248	华润新能源	6,672	67,453.92	0.05
54	002142	宁波银行	2,200	65,318.00	0.04
55	000708	中信特钢	5,100	64,362.00	0.04
56	601339	百隆东方	7,000	47,390.00	0.03
57	600999	招商证券	1,800	37,980.00	0.03
58	688820	盛合晶微	239	33,816.11	0.02
59	688797	臻宝科技	60	28,120.20	0.02
60	002961	瑞达期货	1,200	23,496.00	0.02
61	001399	惠科股份	805	22,322.65	0.02
62	688635	长进光子	71	21,881.49	0.01
63	688811	有研复材	510	12,306.30	0.01
64	301263	泰恩康	600	12,294.00	0.01
65	688781	视涯科技	256	12,188.16	0.01
66	000776	广发证券	500	11,700.00	0.01
67	603459	红板科技	109	9,190.88	0.01
68	603407	长裕集团	119	8,741.74	0.01
69	301669	高特电子	306	8,690.40	0.01
70	002345	潮宏基	800	7,336.00	0.01

71	002293	罗莱生活	700	6,923.00	0.00
72	603856	东宏股份	500	6,915.00	0.00
73	300628	亿联网络	200	6,764.00	0.00
74	601825	沪农商行	900	6,741.00	0.00
75	002959	小熊电器	200	6,344.00	0.00
76	002624	完美世界	500	6,210.00	0.00
77	301297	富乐德	100	6,124.00	0.00
78	601963	重庆银行	600	6,048.00	0.00
79	605189	富春染织	500	6,025.00	0.00
80	600848	上海临港	800	5,992.00	0.00
81	600637	东方明珠	700	5,817.00	0.00
82	600926	杭州银行	400	5,780.00	0.00
83	001914	招商积余	700	5,712.00	0.00
84	001365	天海电子	180	5,635.80	0.00
85	002997	瑞鹄模具	200	5,512.00	0.00
86	300302	同有科技	100	5,117.00	0.00
87	601881	中国银河	400	5,028.00	0.00
88	002736	国信证券	500	4,995.00	0.00
89	001393	维通利	126	4,912.74	0.00
90	601898	中煤能源	400	4,872.00	0.00
91	002739	儒意电影	500	4,800.00	0.00
92	300088	长信科技	400	4,640.00	0.00
93	002299	圣农发展	300	4,548.00	0.00
94	300146	汤臣倍健	500	4,520.00	0.00
95	300532	今天国际	700	4,361.00	0.00
96	001237	惠康科技	73	4,288.02	0.00
97	300134	大富科技	500	4,275.00	0.00
98	000028	国药一致	220	4,160.20	0.00
99	600626	申达股份	1,300	4,147.00	0.00
100	000893	亚钾国际	100	4,089.00	0.00
101	000810	创维数字	300	3,975.00	0.00
102	600051	宁波联合	700	3,941.00	0.00
103	301316	慧博云通	100	3,938.00	0.00
104	002304	洋河股份	100	3,815.00	0.00
105	002936	郑州银行	2,300	3,795.00	0.00
106	603435	嘉德利	80	3,736.80	0.00
107	600573	惠泉啤酒	400	3,560.00	0.00
108	300492	华图山鼎	100	3,435.00	0.00
109	601009	南京银行	300	2,967.00	0.00
110	603737	三棵树	120	2,892.00	0.00
111	002925	盈趣科技	100	2,466.00	0.00
112	600203	福日电子	200	2,430.00	0.00
113	601020	华钰矿业	100	2,399.00	0.00

114	300735	光弘科技	100	2,274.00	0.00
115	601865	福莱特	200	2,102.00	0.00
116	601818	光大银行	700	2,023.00	0.00
117	002320	海峡股份	300	1,881.00	0.00
118	600210	紫江企业	300	1,860.00	0.00
119	002312	川发龙蟒	200	1,834.00	0.00
120	601007	金陵饭店	300	1,833.00	0.00
121	601229	上海银行	200	1,736.00	0.00
122	300691	联合光电	100	1,581.00	0.00
123	002117	东港股份	200	1,576.00	0.00
124	300249	依米康	100	1,540.00	0.00
125	600067	冠城新材	500	1,450.00	0.00
126	002314	南山控股	700	1,400.00	0.00
127	600654	中安科	500	1,330.00	0.00
128	601808	中海油服	100	1,081.00	0.00
129	601966	玲珑轮胎	100	1,019.00	0.00
130	603293	埃泰克	30	1,017.90	0.00
131	600027	华电国际	200	890.00	0.00
132	601577	长沙银行	100	871.00	0.00
133	002968	新大正	100	846.00	0.00
133	601228	广州港	300	846.00	0.00
134	002145	钛能化学	100	471.00	0.00
135	300068	ST 南都	100	411.00	0.00
136	002016	世荣兆业	100	400.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	3,236,967.00	1.28
2	300308	中际旭创	3,078,585.00	1.21
3	601398	工商银行	2,877,004.00	1.13
4	688256	寒武纪	2,669,579.45	1.05
5	688012	中微公司	2,615,541.99	1.03
6	000338	潍柴动力	2,446,439.00	0.97
7	300502	新易盛	2,235,986.00	0.88
8	601166	兴业银行	2,179,438.00	0.86
9	601899	紫金矿业	2,048,271.00	0.81
10	000333	美的集团	1,868,113.00	0.74
11	601318	中国平安	1,836,340.00	0.72
12	600030	中信证券	1,745,624.00	0.69
13	600150	中国船舶	1,724,068.80	0.68
14	300476	胜宏科技	1,698,114.00	0.67
15	600519	贵州茅台	1,679,280.00	0.66

16	600089	特变电工	1, 570, 349. 00	0. 62
17	301308	江波龙	1, 519, 421. 00	0. 60
18	300857	协创数据	1, 497, 064. 80	0. 59
19	300274	阳光电源	1, 476, 178. 00	0. 58
20	600900	长江电力	1, 467, 693. 00	0. 58

注：1、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。

2、“买入金额”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。

7.4.2 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	300308	中际旭创	3, 867, 803. 00	1. 53
2	300750	宁德时代	3, 712, 407. 00	1. 46
3	688256	寒武纪	2, 876, 712. 72	1. 13
4	300502	新易盛	2, 811, 864. 00	1. 11
5	601166	兴业银行	2, 725, 089. 00	1. 08
6	601398	工商银行	2, 677, 377. 00	1. 06
7	688012	中微公司	2, 593, 216. 60	1. 02
8	300476	胜宏科技	2, 449, 957. 00	0. 97
9	601899	紫金矿业	2, 252, 427. 00	0. 89
10	002475	立讯精密	2, 222, 020. 00	0. 88
11	600519	贵州茅台	2, 201, 174. 00	0. 87
12	000333	美的集团	2, 069, 733. 00	0. 82
13	000338	潍柴动力	2, 064, 906. 00	0. 81
14	601318	中国平安	2, 044, 688. 00	0. 81
15	600089	特变电工	1, 917, 747. 00	0. 76
16	601328	交通银行	1, 879, 065. 00	0. 74
17	601857	中国石油	1, 858, 722. 00	0. 73
18	300274	阳光电源	1, 811, 568. 00	0. 71
19	300033	同花顺	1, 760, 912. 80	0. 69
20	600406	国电南瑞	1, 746, 812. 00	0. 69

注：1、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。

2、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。

7.4.3 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	267, 726, 463. 56
卖出股票收入（成交）总额	288, 409, 394. 97

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	4,041,969.32	2.77
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	4,041,969.32	2.77

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019792	25 国债 19	40,000	4,041,969.32	2.77

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值和流动性管理为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险和流动性风险，改善组合的风险收益特性。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控，在追求基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的中长期稳定增值。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	6,281,619.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,281,619.39

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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。

7.12.6 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，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 (%)
宝盈中证 A500 指数增强 A	1,140	38,300.82	—	—	43,662,932.56	100.00
宝盈中证 A500 指数增强 C	12,442	6,628.08	300,091.67	0.36	82,166,521.61	99.64
合计	13,582	9,286.52	300,091.67	0.24	125,829,454.17	99.76

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	宝盈中证 A500 指数增强 A	714.34	0.0016
	宝盈中证 A500 指数增强 C	702.12	0.0009
	合计	1,416.46	0.0011

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	宝盈中证 A500 指数增强 A	0
	宝盈中证 A500 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	宝盈中证 A500 指数增强 A	0
	宝盈中证 A500 指数增强 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	宝盈中证 A500 指数增强 A	宝盈中证 A500 指数增强 C
基金合同生效日 (2025 年 12 月 9 日)		
基金份额总额	101,848,611.69	149,798,422.16
本报告期期初基金份 额总额	101,848,611.69	149,798,422.16
本报告期基金总申购 份额	4,686,089.32	77,216,234.43
减:本报告期基金总 赎回份额	62,871,768.45	144,548,043.31
本报告期基金拆分变 动份额	—	—
本报告期期末基金份 额总额	43,662,932.56	82,466,613.28

§ 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的情况。

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 (%)	
长城证券	3	555,741,350.56	100.00	109,440.75	100.00	-

注：本基金采用券商交易模式。

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

本基金管理人选择财务状况良好，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，若服务评价总分能够进入前二十五名，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、本报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：无。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
长城证券	4,804,900.00	100.00	558,000,000.00	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网站	2026 年 5 月 29 日
4	宝盈中证 A500 指数增强型证券投资基金 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
5	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
6	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	2026 年 3 月 31 日

		网站	
7	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
8	宝盈基金管理有限公司关于增加邮储银行邮你同赢平台销售旗下部分基金的公告	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 3 月 19 日
9	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
10	宝盈中证 A500 指数增强型证券投资基金(宝盈中证 A500 指数增强 A 份额)基金产品资料概要(更新)	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 4 日
11	宝盈中证 A500 指数增强型证券投资基金(宝盈中证 A500 指数增强 C 份额)基金产品资料概要(更新)	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 4 日
12	宝盈中证 A500 指数增强型证券投资基金招募说明书(2026 年第 1 次)	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 4 日
13	宝盈中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理变更公告	上海证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2026 年 2 月 28 日
14	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
15	宝盈中证 A500 指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	上海证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2026 年 1 月 7 日
16	关于宝盈中证 A500 指数增强型证券投资基金增加万联证券股份有限公司为代销机构的公告	上海证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2026 年 1 月 7 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中证 A500 指数增强型证券投资基金注册的文件。

《宝盈中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》。

《宝盈中证 A500 指数增强型证券投资基金托管协议》。

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：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：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

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