

华宝深证 100 交易型开放式指数证券投资
基金(原华宝深证创新 100 交易型开放式指
数证券投资基金)
2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2026 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 03 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2025 年 09 月 11 日（基金合同生效日）起至 2025 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况（转型后）	6
2.1 基金基本情况（转型前）	6
2.2 基金产品说明（转型后）	6
2.2 基金产品说明（转型前）	7
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料(转型后)	7
2.5 其他相关资料(转型前)	8
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标(转型后)	8
3.1 主要会计数据和财务指标(转型前)	8
3.2 基金净值表现（转型后）	9
3.2 基金净值表现（转型前）	11
3.3 过去三年基金的利润分配情况（转型后）	12
3.4 过去三年基金的利润分配情况（转型前）	12
§4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	16
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.....	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	18
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	19
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.....	19
§5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	19
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.....	20
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	20
§6 审计报告（转型后）	20
6.1 审计报告基本信息	20
6.2 审计报告的基本内容	20

§6 审计报告（转型前）	22
6.1 审计报告基本信息	22
6.2 审计报告的基本内容	22
§7 年度财务报表（转型后）	24
7.1 资产负债表	24
7.2 利润表	26
7.3 净资产变动表	27
7.4 报表附注	28
§7 年度财务报表（转型前）	52
7.1 资产负债表	52
7.2 利润表	54
7.3 净资产变动表	55
7.4 报表附注	57
§8 投资组合报告（转型后）	86
8.1 期末基金资产组合情况	86
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	87
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	88
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	91
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	92
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	93
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	93
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	93
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	93
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	93
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	93
8.12 投资组合报告附注	93
§8 投资组合报告（转型前）	94
8.1 期末基金资产组合情况	94
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	95
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	96
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	99
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	100
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	101
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	101
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	101
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	101
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	101
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	101
8.12 投资组合报告附注	101
§9 基金份额持有人信息（转型后）	102

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	102
9.2 期末上市基金前十名持有人	102
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	103
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	103
§9 基金份额持有人信息（转型前）	103
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	103
9.2 期末上市基金前十名持有人	103
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	103
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	103
§10 开放式基金份额变动（转型后）	103
§10 开放式基金份额变动（转型前）	104
§11 重大事件揭示.....	104
11.1 基金份额持有人大会决议	104
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	104
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	104
11.4 基金投资策略的改变	104
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	105
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	105
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型后).....	105
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型前).....	107
11.8 其他重大事件（转型后）	109
11.8 其他重大事件（转型前）	112
§12 影响投资者决策的其他重要信息	114
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	114
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	114
§13 备查文件目录.....	114
13.1 备查文件目录	114
13.2 存放地点	114
13.3 查阅方式	115

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	华宝深证 100 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华宝深证 100ETF
场内简称	深证 100ETF 华宝
基金主代码	159716
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 9 月 11 日
基金管理人	华宝基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	59,666,732.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2021 年 6 月 28 日

2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华宝深创 100ETF
场内简称	深创 100ETF
基金主代码	159716
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 6 月 18 日
基金管理人	华宝基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	83,666,732.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2021 年 6 月 28 日

2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	<p>本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。</p> <p>对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将通过投资成份股、非成份股、成份股个股衍生品等进行替代。</p>
业绩比较基准	深证 100 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用组合复制策略，跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所

	表征的市场组合的风险收益特征相似。
--	-------------------

2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将通过投资成份股、非成份股、成份股个股衍生品等进行替代。
业绩比较基准	深证创新 100 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用组合复制策略，跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华宝基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周雷	许俊
	联系电话	021-38505888	010-66596688
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400-700-5588、400-820-5050	95566
传真		021-38505777	010-66594942
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		夏雪松	葛海蛟

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料(转型后)

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海南京西路 1266 号恒隆广场 2 期 25 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

2.5 其他相关资料(转型前)

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海南京西路 1266 号恒隆广场 2 期 25 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标(转型后)

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2025 年 9 月 11 日（基金合同生效日） - 2025 年 12 月 31 日
本期已实现收益	4,152,097.61
本期利润	4,860,267.28
加权平均基金份额本期利润	0.0721
本期加权平均净值利润率	6.82%
本期基金份额净值增长率	6.03%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末
期末可供分配利润	1,317,392.89
期末可供分配基金份额利润	0.0221
期末基金资产净值	63,574,877.42
期末基金份额净值	1.0655
3.1.3 累计期末指标	2025 年末
基金份额累计净值增长率	6.03%

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

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

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

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

5. 本基金合同在当期生效。

3.1 主要会计数据和财务指标(转型前)

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2025 年 1 月 1 日 - 2025 年 9 月 10 日	2024 年	2023 年
本期已实现收益	21,117,557.01	-36,750,027.61	-5,281,676.08
本期利润	22,073,135.82	20,023,230.13	-11,874,028.45

加权平均基金份额本期利润	0.1882	0.1232	-0.0691
本期加权平均净值利润率	22.95%	18.56%	-9.55%
本期基金份额净值增长率	27.40%	22.16%	-10.38%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年 9 月 10 日	2024 年末	2023 年末
期末可供分配利润	-3,163,932.75	-35,016,278.13	-60,109,954.22
期末可供分配基金份额利润	-0.0378	-0.2581	-0.3543
期末基金资产净值	84,075,426.73	107,018,140.64	109,556,777.78
期末基金份额净值	1.0049	0.7888	0.6457
3.1.3 累计期末指标	2025 年 9 月 10 日	2024 年末	2023 年末
基金份额累计净值增长率	0.49%	-21.12%	-35.43%

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

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

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

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

3.2 基金净值表现（转型后）

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-2.10%	1.32%	-2.37%	1.34%	0.27%	-0.02%

过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	6.03%	1.33%	5.86%	1.36%	0.17%	-0.03%

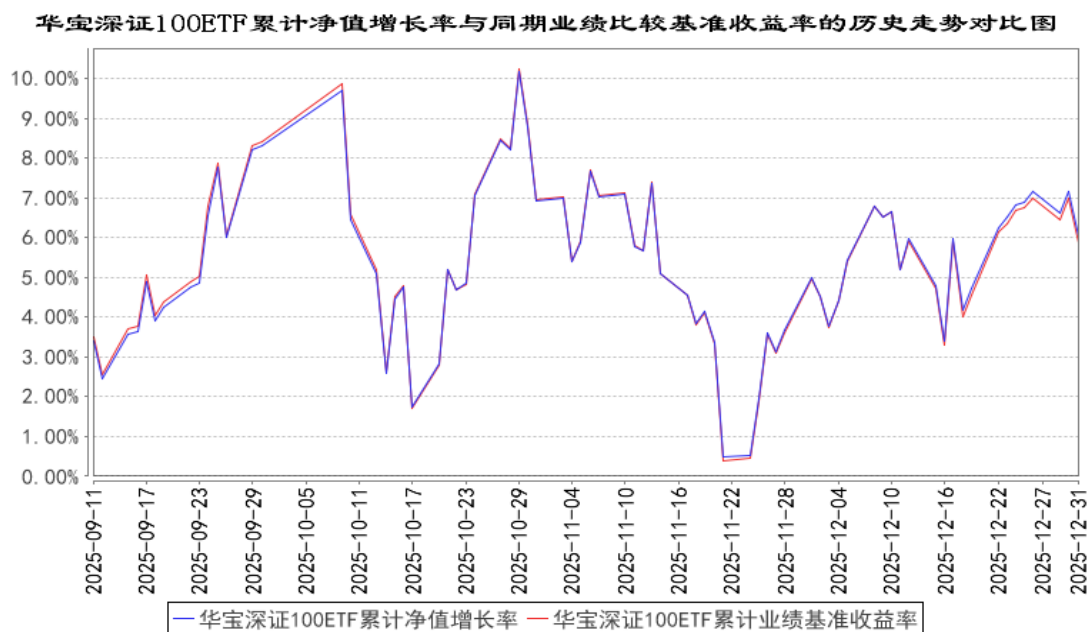
注：

(1) 本基金自 2025 年 09 月 11 日起，由华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金转型而来，截止报告日，本基金基金合同自转型之日起生效未满一年；

(2) 基金业绩基准：深证 100 指数收益率；

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

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

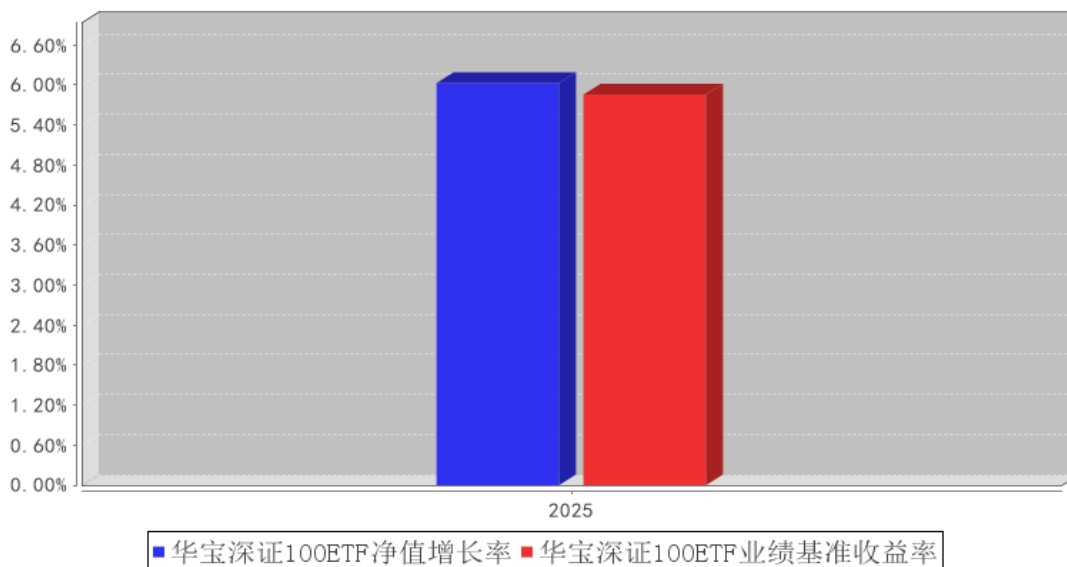


注：1、本基金基金合同生效于 2025 年 09 月 11 日，截止报告日本基金基金合同生效未满一年。

2、按照基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期。

3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华宝深证100ETF基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



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

3.2 基金净值表现（转型前）

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

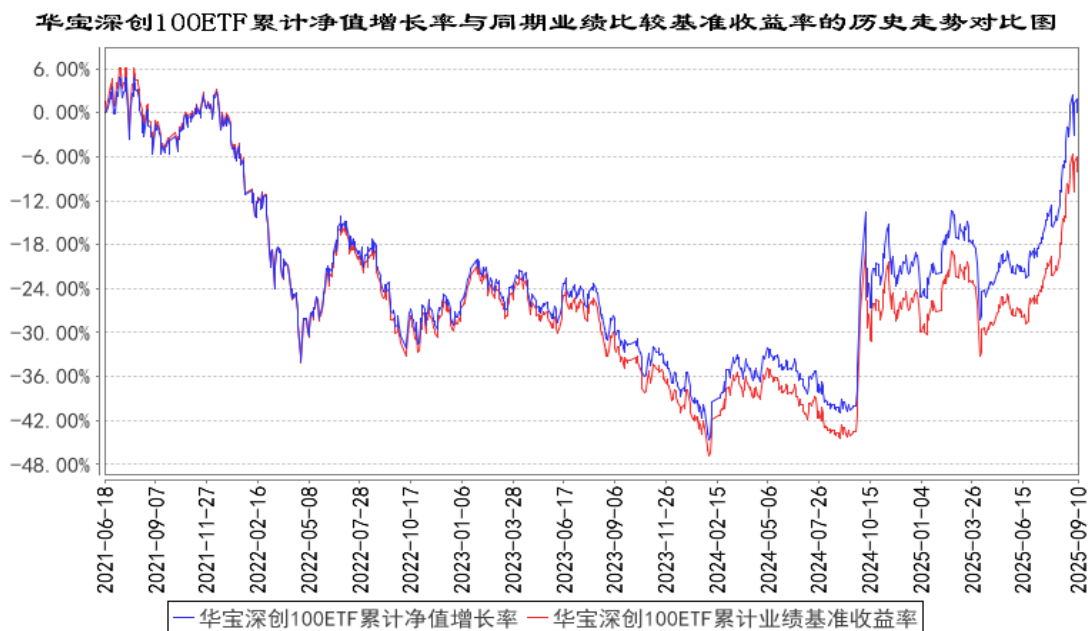
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	28.18%	1.31%	27.60%	1.33%	0.58%	-0.02%
过去六个月	19.82%	1.47%	18.04%	1.50%	1.78%	-0.03%
过去一年	68.86%	1.99%	65.50%	2.03%	3.36%	-0.04%
过去三年	31.26%	1.49%	22.59%	1.52%	8.67%	-0.03%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效日起至今	0.49%	1.49%	-6.07%	1.51%	6.56%	-0.02%

注：（1）本基金成立于 2021 年 06 月 18 日；

（2）基金业绩基准：深证创新 100 指数收益率；

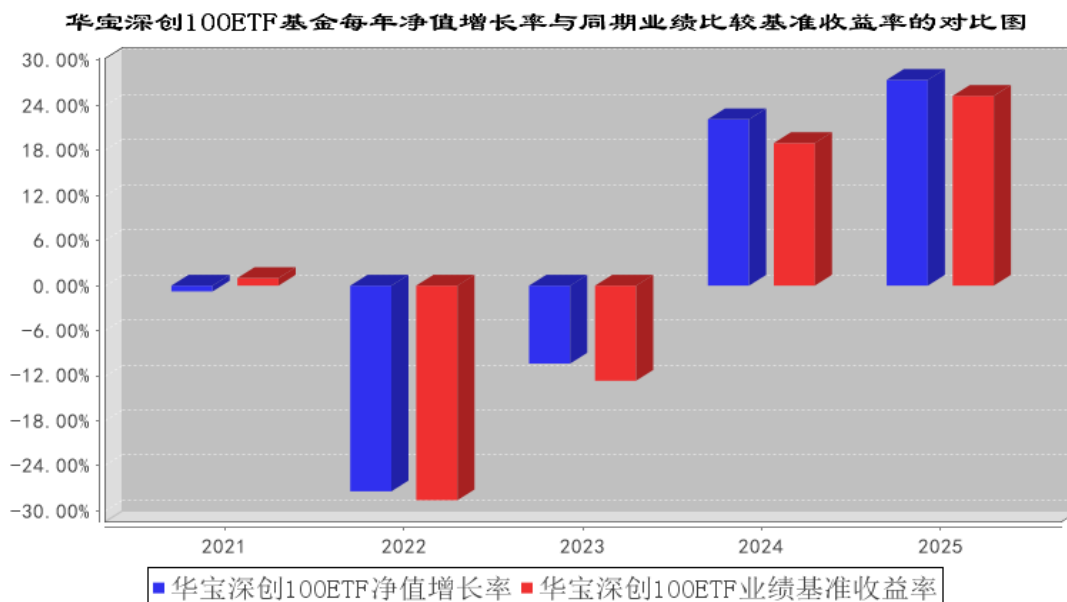
（3）净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

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



注：本基金于 2025 年 9 月 11 日转型。

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



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

3.3 过去三年基金的利润分配情况（转型后）

本基金成立于2025年09月11日，成立至今未进行利润分配。

3.4 过去三年基金的利润分配情况（转型前）

本基金成立于2021年06月18日，成立至今未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华宝基金管理有限公司（公司原名“华宝兴业基金管理有限公司”）于 2003 年 2 月 12 日经中国证监会批准设立，2003 年 3 月 7 日在国家工商总局注册登记并正式开业，是国内首批中外合资基金管理公司。成立之初，公司注册资本为 1 亿元人民币，2007 年经中国证监会批准，公司注册资本增加至 1.5 亿元人民币。2017 年公司名称变更为“华宝基金管理有限公司”。目前公司股东为华宝信托有限责任公司、美国华平资产管理有限合伙（Warburg Pincus Asset Management, L.P.）和江苏省铁路集团有限公司，持有股权占比分别为 51%、29%、20%。公司在北京和深圳设有分公司。截至本报告期末（2025 年 12 月 31 日），本公司正在管理运作的公开募集证券投资基金共 163 只，涵盖股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金、FOF 等。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
蒋俊阳	本基金基金经理、指数研发投资部副总经理	2025 年 9 月 11 日	-	17 年	硕士。曾在上海申银万国证券研究所、光大证券研究所从事研究工作。2018 年 10 月加入华宝基金管理有限公司担任基金经理助理。2020 年 7 月起任华宝中证电子 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2020 年 12 月起任华宝中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 3 月至 2022 年 2 月任华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 6 月至 2025 年 9 月任华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 7 月起任华宝中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，2021 年 7 月起任华宝中证电子 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，2021 年 9 月至 2024 年 9 月任华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，2021 年 11 月起任华宝中证 800 地产交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2024 年 3 月起任华宝中证 A50 交易型开放式指数证券投资基

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

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
蒋俊阳	本基金基金经理、指数研发投资部副总经理	2021 年 6 月 18 日	2025 年 9 月 10 日	17 年	<p>硕士。曾在上海申银万国证券研究所、光大证券研究所从事研究工作。2018 年 10 月加入华宝基金管理有限公司担任基金经理助理。2020 年 7 月起任华宝中证电子 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2020 年 12 月起任华宝中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 3 月至 2022 年 2 月任华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 6 月至 2025 年 9 月任华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 7 月起任华宝中证细分食品饮料产</p>

				<p>业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，2021 年 7 月起任华宝中证电子 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，2021 年 9 月至 2024 年 9 月任华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，2021 年 11 月起任华宝中证 800 地产交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2024 年 3 月起任华宝中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2024 年 4 月起任华宝中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，2024 年 11 月起任华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 1 月起任华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2025 年 4 月起任华宝深证 100 指数型发起式证券投资基金基金经理，2025 年 9 月起任华宝深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 9 月至 2025 年 11 月任华宝港股通恒生中国(香港上市)30 指数证券投资基金(LOF)基金经理，2025 年 9 月起任华宝港股通恒生中国(香港上市)30 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 11 月起任华宝港股通恒生中国(香港上市)30 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金经理，2025 年 12 月起任华宝北证 50 成份指数型证券投资基金基金经理，2026 年 2 月起任华宝中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金、华宝中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。</p>
--	--	--	--	---

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况（转型后）

本报告期内，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.1.3 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（转型前）

本报告期内，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

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

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

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

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

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

3) 对公司管理的不同投资组合的所有银行间债券买卖和回购交易进行分析。监督的内容包括以下几点，同一投资组合短期内对同一债券的反向交易，债券买卖到期收益率与中债登估价收

益率之间的差异，回购利率与当日市场平均利率之间的差异。对上述监督内容存在异常的情况要求投资组合经理进行合理性解释。

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制，确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求，分析了本公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差；分析结果未发现异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 1 次，系指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内，本基金没有发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2025 年，我国经济运行稳中有进，经济结构深度调整，高质量发展扎实推进。产业政策导向明确，新质生产力相关领域成为中长期投资主线，技术突破与国产替代加速落地。全球流动性周期转向宽松预期增强，外资回流与国内长线资金入市成为 A 股重要支撑力量，估值修复动能逐步释放。2025 年 A 股市场整体呈现震荡上行的“慢牛”格局，科技与资源成为主要驱动因素，有色、通信、电子、电气设备、国防军工等行业表现较好，食品饮料、煤炭等行业表现相对较弱。指数方面，以中证 100 和沪深 300 为代表的大盘蓝筹股指数全年分别上涨了 20.44% 和 17.66%；而以成长股为代表的中证 1000 和创业板指全年分别上涨了 27.49% 和 49.57%。在本报告期内，深证 100 指数累计上涨了 24.73%。

本报告期本基金由华宝深创 100ETF 转型而来，涵盖转型期。我们在操作中严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金自转型以来，本报告期基金份额净值增长率为 6.03%，业绩比较基准收益率为 5.86%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年，央行将继续实施适度宽松的货币政策，灵活高效运用降准降息等多种货币政策工具，保持流动性充裕，把促进经济稳定增长、物价合理回升作为货币政策的重要考量。2026 年为“十五五”开局之年，“十五五”规划通过科技创新、内需提振与安全能力建设的三维驱动，为中国式现代化提供系统性支撑，同时将深化供给侧结构性改革，优化产业布局，并对资本市场带来结构性机遇。

深证 100 指数由深圳证券市场中市值大、流动性好的 100 只股票组成，定位旗舰型指数，表征深交所创新型、成长型龙头企业。

作为指数基金的管理人，我们将继续严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，积极应对成分股调整和基金申购赎回，严格控制基金相对目标指数的跟踪误差，实现对深证 100 指数的有效跟踪。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

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

识。

(三) 有重点地全面开展内部审计稽核工作。本年度, 合规审计部门依据监管规定与年度审计计划对公司投研、市场、运营部门进行了专项审计与定期稽核, 对投资组合经理开展离任审查, 发现问题并提出审计建议, 并与相关责任部门进行沟通, 定期进行整改跟踪的闭环管理, 不断提高工作质量。

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会和基金合同关于估值的约定, 对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人设有估值委员会, 定期评价现行估值政策和程序, 在发生了影响估值政策和程序的有效性及其适用性的情况后及时修订估值方法。基金在投资新品种时, 由估值委员会评价现有估值政策和程序的适用性。参与估值的人员均具备估值业务所需的专业胜任能力, 参与估值各方之间不存在重大利益冲突。

本基金的估值由基金会计负责, 基金会计以本基金为会计核算主体, 基金会计核算独立于公司会计核算, 独立建账、独立核算。基金会计采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及账务处理; 每日按时接收成交数据及权益数据, 进行基金估值。基金会计核算采用基金管理人与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式进行; 基金会计每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对, 每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议, 由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据, 由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内, 中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在华宝深证 100 交易型开放式指

数证券投资基金(原华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金)(以下称“本基金”)的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等财务数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告(转型后)

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 2601906 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华宝深证 100 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人:
审计意见	我们审计了后附的华宝深证 100 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“该基金”)财务报表,包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表,自 2025 年 9 月 11 日(基金合同生效日)至 2025 年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制,公允反映了该基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2025 年 9 月 11 日(基金合同生效日)至 2025 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则(以下简称“审计准则”)的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。

	<p>按照中国注册会计师职业道德守则和《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》中适用于公众利益实体财务报表审计业务的独立性要求，我们独立于该基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
<p>强调事项</p>	<p>-</p>
<p>其他事项</p>	<p>-</p>
<p>其他信息</p>	<p>该基金管理人华宝基金管理有限公司（以下简称“该基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2025 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。</p> <p>该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p>

	<p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对该基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致该基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与该基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	黄小熠 侯雯
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场东2座办公楼8层
审计报告日期	2026年3月25日

§ 6 审计报告（转型前）

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 2601907 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>我们审计了后附的华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“该基金”）财务报表，包括 2025 年 9 月 10 日（基金合同失效前日）的资产负债表，自 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 9 月 10 日（基金合同失效前日）止期间财务报表的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了该基金 2025 年 9 月 10 日（基金合同失效前日）的财务状况以及自 2025 年 1 月 1 日至 2025</p>

	<p>年 9 月 10 日（基金合同失效前日）止期间的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则和《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》中适用于公众利益实体财务报表审计业务的独立性要求，我们独立于该基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>该基金管理人华宝基金管理有限公司（以下简称“该基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金自 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 9 月 10 日（基金合同失效前日）止期间报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对</p>

	<p>这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (3) 评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (4) 对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对该基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致该基金不能持续经营。 (5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与该基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	黄小熠 侯雯
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场东2座办公楼8层
审计报告日期	2026年3月25日

§ 7 年度财务报表（转型后）

7.1 资产负债表

会计主体：华宝深证 100 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日
资产：		
货币资金	7.4.7.1	961,920.43
结算备付金		-
存出保证金		1,058.72
交易性金融资产	7.4.7.2	62,798,103.22
其中：股票投资		62,798,103.22
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-

其他投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
债权投资		-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资		-
其他权益工具投资		-
应收清算款		355.86
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.5	-
资产总计		63,761,438.23
负债和净资产	附注号	本期末 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	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		15,762.00
应付赎回款		-
应付管理人报酬		28,495.17
应付托管费		5,699.06
应付销售服务费		-
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.6	136,604.58
负债合计		186,560.81
净资产：		
实收基金	7.4.7.7	59,666,732.00
其他综合收益		-
未分配利润	7.4.7.8	3,908,145.42
净资产合计		63,574,877.42
负债和净资产总计		63,761,438.23

注：1. 本基金合同生效日为 2025 年 09 月 11 日，本报告期自基金合同生效日 2025 年 09 月 11 日起至 2025 年 12 月 31 日止。

2. 报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0655 元，基金份额总额 59,666,732.00 份。

7.2 利润表

会计主体：华宝深证 100 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 9 月 11 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 9 月 11 日（基金合同 生效日）至 2025 年 12 月 31 日
一、营业总收入		5,068,626.54
1. 利息收入		1,628.10
其中：存款利息收入	7.4.7.9	1,628.10
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,358,828.77
其中：股票投资收益	7.4.7.10	4,167,777.81
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.11	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	191,050.96
以摊余成本计量的金融资产 终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-” 号填列）	7.4.7.16	708,169.67
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-
减：二、营业总支出		208,359.26
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	109,851.99
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	7.4.10.2.2	21,970.40
3. 销售服务费		-
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	7.4.7.18	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	7.4.7.19	76,536.87
三、利润总额（亏损总额以“-”号 填列）		4,860,267.28

减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,860,267.28
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		4,860,267.28

注：本产品成立于 2025 年 09 月 11 日，故无上年度可比期间。

7.3 净资产变动表

会计主体：华宝深证 100 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 9 月 11 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 9 月 11 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	83,666,732.00	-	408,694.73	84,075,426.73
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-24,000,000.00	-	3,499,450.69	-20,500,549.31
（一）、综合收益总额	-	-	4,860,267.28	4,860,267.28
（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）	-24,000,000.00	-	-1,360,816.59	-25,360,816.59
其中：1. 基金申购款	-	-	-	-
2. 基金赎回款	-24,000,000.00	-	-1,360,816.59	-25,360,816.59
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-

(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	59,666,732.00	-	3,908,145.42	63,574,877.42

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华宝深证 100 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）是由原华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“华宝深创 100ETF”）转型而来。根据本基金的基金管理人华宝基金管理有限公司于 2025 年 9 月 2 日发布的《华宝基金管理有限公司关于华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金实施转型的公告》，自 2025 年 9 月 11 日起华宝深创 100ETF 转型为本基金，《华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》等法律文件失效，同日《华宝深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》等法律文件生效。本基金为交易型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为华宝基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会少量投资于国内依法发行上市的非成份股包括创业板、存托凭证及其他经中国证监会允许上市的股票、债券包括国内依法发行的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券、货币市场工具、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具但须符合中国证监会的相关规定。本基金可根据法律法规的规定参与融资以及转融通证券出借业务。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：

标的指数收益率，即深证 100 指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人华宝基金管理有限公司于 2026 年 3 月 25 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况、自 2025 年 9 月 11 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 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自 2025 年 9 月 11 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资和债券投资等。本基金通常根据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，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、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摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务

模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，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。除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无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。管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(b) 金融负债的分类

本基金将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及以摊余成本计量的金融负债。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入

当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b) 金融工具的后续计量

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

- 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 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；
- 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。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

(d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限（包括考虑续约选择权）。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内（若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期）可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人

没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，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，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，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。采用估值技术确定公允价值时，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。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似金融工具的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，

以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额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。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日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。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的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进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入证券出借业务利息收入。

投资收益

股票投资收益、债券投资收益、衍生工具收益和资产支持证券投资收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当

期损益的金融资产、衍生工具、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权；本基金基金份额的收益分配方式采用现金分红；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。证券交易所或基金登记机构对收益分配另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

对于证券交易所上市的股票，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《中国证券监督管理委员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。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[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》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”），在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证监会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财税[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[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

- a) 资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税

人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。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，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续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。

b) 对证券投资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。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）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。

d) 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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

e) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末	
	2025 年 12 月 31 日	
活期存款	961,920.43	
等于：本金	961,792.89	
加：应计利息	127.54	
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	961,920.43	

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2025 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	53,585,585.57	-	62,798,103.22	9,212,517.65
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	53,585,585.57	-	62,798,103.22	9,212,517.65

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日
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	1,604.58
其中：交易所市场	1,604.58
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	135,000.00
合计	136,604.58

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 9 月 11 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	83,666,732.00	83,666,732.00
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-24,000,000.00	-24,000,000.00
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	59,666,732.00	59,666,732.00

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-3,163,932.75	3,572,627.48	408,694.73
加：会计政策变更	-	-	-

前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-3,163,932.75	3,572,627.48	408,694.73
本期利润	4,152,097.61	708,169.67	4,860,267.28
本期基金份额交易产生的变动数	329,228.03	-1,690,044.62	-1,360,816.59
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	329,228.03	-1,690,044.62	-1,360,816.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,317,392.89	2,590,752.53	3,908,145.42

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2025年9月11日（基金合同生效日）至2025年12月31日	
活期存款利息收入		1,550.63
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		75.90
其他		1.57
合计		1,628.10

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2025年9月11日（基金合同生效日）至2025年12月31日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		656,126.33
股票投资收益——赎回差价收入		3,511,651.48
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		4,167,777.81

7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2025年9月11日（基金合同生效日）至2025年12月31日	
卖出股票成交总额		4,741,068.05
减：卖出股票成本总额		4,079,957.01
减：交易费用		4,984.71
买卖股票差价收入		656,126.33

7.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年9月11日（基金合同生效日）至2025年12月31日
赎回基金份额对价总额	25,360,816.59
减：现金支付赎回款总额	38,226.59
减：赎回股票成本总额	21,810,938.52
减：交易费用	-
赎回差价收入	3,511,651.48

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益。

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

7.4.7.13 贵金属投资收益

7.4.7.13.1 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2025年9月11日（基金合同生效日）至2025年12月31日
股票投资产生的股利收益	191,050.96
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	191,050.96

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025年9月11日（基金合同生效日）至2025年12月31日
1. 交易性金融资产	708,169.67
股票投资	708,169.67

债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	708,169.67

7.4.7.17 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

7.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年9月11日（基金合同生效日）至2025年 12月31日
审计费用	-6,626.44
信息披露费	36,821.19
证券出借违约金	-
银行费用	315.00
注册登记费用	46,027.12
合计	76,536.87

注：于本报告期内，本基金的基金管理人根据与本基金的审计师最终商定的审计费用，对本基金的审计费进行了调整。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华宝基金管理有限公司（“华宝基金”）	基金管理人
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
华宝信托有限责任公司（“华宝信托”）	基金管理人的股东

华平资产管理有限合伙(Warburg Pincus Asset Management. L. P.)	基金管理人的股东
江苏省铁路集团有限公司(“江苏铁集”)	基金管理人的股东
中国宝武钢铁集团有限公司(“宝武集团”)	华宝信托的最终控制人
华宝证券股份有限公司(“华宝证券”)	受宝武集团控制的公司, 基金销售机构
华宝投资有限公司(“华宝投资”)	受宝武集团控制的公司
宝武集团财务有限责任公司(“宝武财务”)	受宝武集团控制的公司
华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(已清盘)(“华宝深创 100ETF 发起式联接”)	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年9月11日(基金合同生效日)至2025年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	109,851.99
其中：应支付销售机构的客户维护费	14,087.97
应支付基金管理人的净管理费	95,764.02

注：支付基金管理人华宝基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.5% 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 × 0.5% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年9月11日(基金合同生效日)至2025年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	21,970.40

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1% 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 × 0.1% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末除基金管理人外其他关联方未投资本基金。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年9月11日（基金合同生效日）至2025年12月 31日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	961,920.43	1,550.63

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2025年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001221	悍高集团	2025年7月23日	6个月	新股锁定	15.43	56.94	60	925.80	3,416.40	-
001233	海安集团	2025年11月18日	6个月	新股锁定	48.00	51.88	41	1,968.00	2,127.08	-
001369	双欣环保	2025年12月23日	6个月	新股锁定	6.85	12.89	101	691.85	1,301.89	-
001388	信通电子	2025年6月24日	6个月	新股锁定	16.42	42.94	47	771.74	2,018.18	-
301449	天溯计量	2025年12月16日	6个月	新股锁定	36.80	65.23	35	1,288.00	2,283.05	-
301491	汉桑科技	2025年7月29日	6个月	新股锁定	28.91	55.11	71	2,052.61	3,912.81	-
301575	艾芬达	2025年9月3日	6个月	新股锁定	27.69	49.55	55	1,522.95	2,725.25	-
301584	建发致新	2025年9月18日	6个月	新股锁定	7.05	26.82	219	1,543.95	5,873.58	-
301609	山大电力	2025年7月16日	6个月	新股锁定	14.66	40.99	117	1,715.22	4,795.83	-
301632	广东建科	2025年8月5日	6个月	新股锁定	6.56	23.68	221	1,449.76	5,233.28	-
301656	联合动力	2025年9月17日	6个月	新股锁定	12.48	25.46	472	5,890.56	12,017.12	-
301667	纳百川	2025年12月10日	6个月	新股锁定	22.63	57.07	47	1,063.61	2,682.29	-

		日								
301668	昊创瑞通	2025年9月15日	6个月	新股锁定	21.00	44.80	68	1,428.00	3,046.40	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002049	紫光国微	2025年12月30日	重大事项停牌	78.81	2026年1月15日	86.69	4,880	379,669.43	384,592.80	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购，因此没有在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购，因此没有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为 ETF 基金，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现与跟踪指数相同的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司内部监督和反馈系统包括内部控制委员会、督察长、合规审计部、风险管理部、各部门负责人和风险控制联络人、各业务岗位。内部控制委员会负责对公司在经营管理和基金运作中的风险进行评估并研究制订相应的控制制度。督察长向董事会负责，总管公司的内控事务并独立地就内控制度的执行情况履行检查、评价、报告和建议职能。风险管理部在督察长指导下对公司内部控制运行情况进行监控，主要针对公司内

部控制制度的总体构架和内部控制的目标进行评估并提出改进意见；合规审计部在督察长的领导下对各部门和岗位的内部控制执行情况进行监督和核查，同时对内控的失控点进行查漏并责令改正。

本基金的基金管理人根据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的四层监控防线。第一层监控防线为一线岗位自控与互控；第二层防线为大业务板块内部各部门和部门之间的自控和互控；第三层监控防线为风险管理部和合规审计部对各岗位、各部门、各项业务全面实施的监督反馈；最后是以内部控制委员会为主体的第四层防线，实施对公司各类业务和风险的总体监督、控制，并对风险管理部和合规审计部的工作予以直接指导。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法是通过结合定性分析和定量分析方法，估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具的特征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定相应置信程度和风险损失的限度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款均存放于大型股份制商业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均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。

于本报告期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金净资产的比例较低（含债券投资比例为零），因此无重大信用风险。

7.4.13.3 流动性风险

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股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，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

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

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	961,920.43	-	-	-	961,920.43
存出保证金	1,058.72	-	-	-	1,058.72
交易性金融资产	-	-	-	62,798,103.22	62,798,103.22
应收清算款	-	-	-	355.86	355.86
资产总计	962,979.15	-	-	62,798,459.08	63,761,438.23
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	28,495.17	28,495.17
应付托管费	-	-	-	5,699.06	5,699.06
应付清算款	-	-	-	15,762.00	15,762.00
其他负债	-	-	-	136,604.58	136,604.58
负债总计	-	-	-	186,560.81	186,560.81
利率敏感度缺口	962,979.15	-	-	62,611,898.27	63,574,877.42

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，以复制、跟踪深证创新 100 指数的方法为原则，根据标的指数成份股票在指数中的权重确定成份股票的买卖数量，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。在因特殊情况（如成份股停牌、流动性不足、法规法律限制等）导致无法获得足够数量的股票时，本基金可以根据市场情况，结合经验判断，综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股、备选成份股等进行替代，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。本基金采用完全复制法进行指数化投资，股票资产跟踪的标的指数为深证创新 100 指数，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资于深创 100 指数的成份股和备选成份股的资产比例不低于该基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量于国内依法发行上市的非成份股、债券、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	62,798,103.22	98.78
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	62,798,103.22	98.78

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2025 年 12 月 31 日）

1. 业绩比较基准上 升 5%	3, 118, 366. 39
2. 业绩比较基准下 降 5%	-3, 118, 366. 39

7. 4. 14 公允价值

7. 4. 14. 1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7. 4. 14. 2 持续的以公允价值计量的金融工具

7. 4. 14. 2. 1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	62, 362, 077. 26
第二层次	384, 592. 80
第三层次	51, 433. 16
合计	62, 798, 103. 22

7. 4. 14. 2. 2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的证券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关证券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

7. 4. 14. 2. 3 第三层次公允价值余额及变动情况

7. 4. 14. 2. 3. 1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 9 月 11 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日	
	交易性金融资产	合计

	债券投资	股票投资	
期初余额	-	105,803.23	105,803.23
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	56,424.49	56,424.49
转出第三层次	-	81,143.07	81,143.07
当期利得或损失总额	-	-29,651.49	-29,651.49
其中：计入损益的利得或损失	-	-29,651.49	-29,651.49
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	51,433.16	51,433.16
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-4,991.33	-4,991.33

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	51,433.16	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	19.2%-242.67%	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期末无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 7 年度财务报表（转型前）

7.1 资产负债表

会计主体：华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 9 月 10 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025年9月10日	上年度末 2024年12月31日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	697,940.55	2,019,805.36
结算备付金		8,232.61	3,115.15
存出保证金		1,329.71	1,756.25
交易性金融资产	7.4.7.2	82,180,508.39	105,203,933.01
其中：股票投资		82,180,508.39	105,203,933.01
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		1,277,726.21	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	46,027.12	-
资产总计		84,211,764.59	107,228,609.77
负债和净资产	附注号	本期末 2025年9月10日	上年度末 2024年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		12,063.67	45,583.97
应付托管费		2,412.74	9,116.78
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	121,861.45	155,768.38
负债合计		136,337.86	210,469.13
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	83,666,732.00	135,666,732.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	408,694.73	-28,648,591.36
净资产合计		84,075,426.73	107,018,140.64
负债和净资产总计		84,211,764.59	107,228,609.77

注：报告截止日 2025 年 09 月 10 日，基金份额净值 1.0049 元，基金份额总额 83,666,732.00 份。

7.2 利润表

会计主体：华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 9 月 10 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 9 月 10 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		22,744,160.42	20,973,286.16
1. 利息收入		4,199.81	7,311.87
其中：存款利息收入	7.4.7.9	4,199.81	7,311.87
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		21,792,367.15	-35,809,661.60
其中：股票投资收益	7.4.7.10	20,372,708.57	-38,128,346.67
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	-	-
资产支持证券投资	7.4.7.12	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	1,419,658.58	2,318,685.07
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-

3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	955,578.81	56,773,257.74
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-7,985.35	2,378.15
减：二、营业总支出		671,024.60	950,056.03
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	334,442.85	539,871.76
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	66,888.62	107,974.27
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.19	269,693.13	302,210.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		22,073,135.82	20,023,230.13
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		22,073,135.82	20,023,230.13
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		22,073,135.82	20,023,230.13

7.3 净资产变动表

会计主体：华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 9 月 10 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 9 月 10 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	135,666,732.00	-	-28,648,591.36	107,018,140.64
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净	135,666,732.00	-	-28,648,591.36	107,018,140.64

资产				
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-52,000,000.00	-	29,057,286.09	-22,942,713.91
（一）、综合收益总额	-	-	22,073,135.82	22,073,135.82
（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）	-52,000,000.00	-	6,984,150.27	-45,015,849.73
其中：1. 基金申购款	58,000,000.00	-	-10,166,703.93	47,833,296.07
2. 基金赎回款	-110,000,000.00	-	17,150,854.20	-92,849,145.80
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	83,666,732.00	-	408,694.73	84,075,426.73
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	169,666,732.00	-	-60,109,954.22	109,556,777.78
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	169,666,732.00	-	-60,109,954.22	109,556,777.78
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-34,000,000.00	-	31,461,362.86	-2,538,637.14

(一)、综合收益总额	-	-	20,023,230.13	20,023,230.13
(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)	-34,000,000.00	-	11,438,132.73	-22,561,867.27
其中: 1. 基金申购款	32,000,000.00	-	-11,395,359.94	20,604,640.06
2. 基金赎回款	-66,000,000.00	-	22,833,492.67	-43,166,507.33
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	135,666,732.00	-	-28,648,591.36	107,018,140.64

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

向辉

李孟恒

张幸骏

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金(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[2021]1088 号《关于准予华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册,由华宝基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 829,620,534.00 元,业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明 2021 验字第 61471289_B17 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华宝深证创新 100 交易型开放式

指数证券投资基金基金合同》于 2021 年 6 月 18 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 829,666,732.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 46,198.00 份基金份额。本基金的基金管理人为华宝基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

经深圳证券交易所以下简称“深交所”深证上[2021]606 号文审核同意，本基金 829,666,732.00 份基金份额于 2021 年 6 月 28 日在深交所挂牌交易。

根据《华宝基金管理有限公司关于华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金实施转型的公告》，本基金于 2025 年 9 月 11 日起转型变更为华宝深证 100 交易型开放式指数证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会少量投资于国内依法发行上市的非成份股包括中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会允许上市的股票、债券包括国内依法发行的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券、货币市场工具、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具但须符合中国证监会的相关规定。本基金可根据法律法规的规定参与融资以及转融通证券出借业务。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：标的指数收益率，即深证创新 100 指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人华宝基金管理有限公司于 2026 年 3 月 25 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和基金

业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2025 年 9 月 10 日（基金合同失效前日）的财务状况、自 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 9 月 10 日（基金合同失效前日）止期间的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 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自 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 9 月 10 日（基金合同失效前日）止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资和债券投资等。本基金通常根据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，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、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摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，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。除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无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。管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合

同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(b) 金融负债的分类

本基金将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及以摊余成本计量的金融负债。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b) 金融工具的后续计量

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

- 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法

摊销或确认减值时，计入当期损益。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 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；
- 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。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

(d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限（包括考

考虑续约选择权)。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内（若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期）可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，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，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，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。采用估值技术确定公允价值时，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。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似金融工具的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额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。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日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。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的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进行确认和计量，

并于会计期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入证券出借业务利息收入。

投资收益

股票投资收益、债券投资收益、衍生工具收益和资产支持证券投资收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生工具、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权；本基金基金份额的收益分配方式采用现金分红；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。证券交易所或基金登记机构对收益分配另有规定的，从其规定。在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配

的原则和有关业务规则进行调整，并及时公告。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

对于证券交易所上市的股票，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《中国证券监督管理委员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。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[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》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”），在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证监会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财税[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[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。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，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在2025年8月8日之后续发行的部分）的利息收入，继续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。

b) 对证券投资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。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）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。

d) 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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

e) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 9 月 10 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	697,940.55	2,019,805.36
等于：本金	696,893.26	2,019,575.84
加：应计利息	1,047.29	229.52
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-

存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
-	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	697,940.55	2,019,805.36

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 9 月 10 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	73,676,160.41	-	82,180,508.39	8,504,347.98
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	73,676,160.41	-	82,180,508.39	8,504,347.98
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	97,655,163.84	-	105,203,933.01	7,548,769.17
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	97,655,163.84	-	105,203,933.01	7,548,769.17

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025年9月10日	上年度末 2024年12月31日
应收利息	-	-
其他应收款	-	-
待摊费用	46,027.12	-
合计	46,027.12	-

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年9月10日	上年度末 2024年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	17,056.20	4,568.38
其中：交易所市场	17,056.20	4,568.38
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	104,805.25	151,200.00
合计	121,861.45	155,768.38

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年9月10日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	135,666,732.00	135,666,732.00
本期申购	58,000,000.00	58,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-110,000,000.00	-110,000,000.00
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	83,666,732.00	83,666,732.00

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-35,016,278.13	6,367,686.77	-28,648,591.36
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-35,016,278.13	6,367,686.77	-28,648,591.36
本期利润	21,117,557.01	955,578.81	22,073,135.82
本期基金份额交易产生的变动数	10,734,788.37	-3,750,638.10	6,984,150.27
其中：基金申购款	-13,937,257.30	3,770,553.37	-10,166,703.93
基金赎回款	24,672,045.67	-7,521,191.47	17,150,854.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,163,932.75	3,572,627.48	408,694.73

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年9月10日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年 12月31日
活期存款利息收入	4,140.34	6,755.74
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	56.83	536.79
其他	2.64	19.34
合计	4,199.81	7,311.87

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年9月10 日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月 31日
股票投资收益——买卖 股票差价收入	11,264,158.76	-27,695,225.94
股票投资收益——赎回 差价收入	9,108,549.81	-10,433,120.73
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	20,372,708.57	-38,128,346.67

7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年9月10日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
卖出股票成交总额	58,613,767.91	56,495,090.84
减：卖出股票成本总额	47,290,926.10	84,128,828.98
减：交易费用	58,683.05	61,487.80
买卖股票差价收入	11,264,158.76	-27,695,225.94

7.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年9月10日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
赎回基金份额对价总额	92,849,145.80	43,166,507.33
减：现金支付赎回款总额	100,478.80	10,488.33
减：赎回股票成本总额	83,640,117.19	53,589,139.73
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	9,108,549.81	-10,433,120.73

7.4.7.11 债券投资收益**7.4.7.11.1 债券投资收益——买卖债券差价收入**

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益。

7.4.7.12 资产支持证券投资收益**7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入**

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.13 贵金属投资收益**7.4.7.13.1 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益**7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年9月10日	2024年1月1日至2024年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,419,658.58	2,318,685.07
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	1,419,658.58	2,318,685.07

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年9月10日	2024年1月1日至2024年12月31日
1. 交易性金融资产	955,578.81	56,773,257.74
股票投资	955,578.81	56,773,257.74
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	955,578.81	56,773,257.74

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年9月10日	2024年1月1日至2024年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	-7,985.35	2,378.15
合计	-7,985.35	2,378.15

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

7.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年9月10日	2024年1月1日至2024年12月31日
审计费用	21,626.44	31,200.00
信息披露费	83,178.81	120,000.00
证券出借违约金	-	-
公证费	20,000.00	-
律师费	40,000.00	-
银行费用	915.00	1,010.00
注册登记费用	103,972.88	150,000.00
合计	269,693.13	302,210.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华宝基金管理有限公司(“华宝基金”)	基金管理人
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人
华宝信托有限责任公司(“华宝信托”)	基金管理人的股东
华平资产管理有限合伙(Warburg Pincus Asset Management, L.P.)	基金管理人的股东
江苏省铁路集团有限公司(“江苏铁集”)	基金管理人的股东
中国宝武钢铁集团有限公司(“宝武集团”)	华宝信托的最终控制人
华宝证券股份有限公司(“华宝证券”)	受宝武集团控制的公司, 基金销售机构
华宝投资有限公司(“华宝投资”)	受宝武集团控制的公司
宝武集团财务有限责任公司(“宝武财务”)	受宝武集团控制的公司
华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(“华宝深创 100ETF 发起式联接”)(已清盘)	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年9月10日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
华宝证券	25,123,182.90	21.32	974,629.03	0.86

7.4.10.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年9月10日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
华宝证券	4,595.96	21.06	51.34	0.30
关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
华宝证券	178.26	0.69	171.78	3.76

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自2024年7月1日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年9月10日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	334,442.85	539,871.76
其中：应支付销售机构的客户维护	38,720.16	4,718.11

费		
应支付基金管理人的净管理费	295,722.69	535,153.65

注：支付基金管理人华宝基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.5% 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 × 0.5% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 9 月 10 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	66,888.62	107,974.27

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1% 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 × 0.1% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用自有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末除基金管理人外其他关联方未投资本基金。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年9月10日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	697,940.55	4,140.34	2,019,805.36	6,755.74

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2025年9月10日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001221	悍高集团	2025年7月23日	6个月	新股锁定	15.43	38.97	60	925.80	2,338.20	-
001335	信凯科技	2025年4月2日	6个月	新股锁定	12.80	39.87	69	883.20	2,751.03	-
001382	新亚电缆	2025年3月13日	6个月	新股锁定	7.40	20.71	207	1,531.80	4,286.97	-
001388	信通电子	2025年6月24日	6个月	新股锁定	16.42	36.79	47	771.74	1,729.13	-
001390	古麒绒	2025年5月21日	6个月	新股锁定	12.08	25.59	75	906.00	1,919.25	-

	材									
301275	汉朔科技	2025年3月4日	6个月	新股锁定	27.50	54.12	88	2,420.00	4,762.56	-
301479	弘景光电	2025年3月6日	6个月	新股锁定	41.90	92.85	56	2,346.40	5,199.60	-
301479	弘景光电	2025年5月28日	1-6个月(含)	新股锁定-送股	-	92.85	23	-	2,135.55	-
301491	汉桑科技	2025年7月29日	6个月	新股锁定	28.91	51.73	71	2,052.61	3,672.83	-
301501	恒鑫生活	2025年3月11日	6个月	新股锁定	39.92	50.18	60	2,395.20	3,010.80	-
301501	恒鑫生活	2025年6月6日	1-6个月(含)	新股锁定-送股	-	50.18	27	-	1,354.86	-
301535	浙江华远	2025年3月18日	6个月	新股锁定	4.92	21.65	505	2,484.60	10,933.25	-
301560	众捷汽车	2025年4月17日	6个月	新股锁定	16.50	35.28	94	1,551.00	3,316.32	-
301575	艾芬达	2025年9月3日	6个月	新股锁定	27.69	59.25	55	1,522.95	3,258.75	-
301590	优优绿能	2025年5月28日	6个月	新股锁定	89.60	199.04	20	1,792.00	3,980.80	-
301595	太力科技	2025年5月12日	6个月	新股锁定	17.05	39.56	103	1,756.15	4,074.68	-

301609	山大电力	2025年7月16日	6个月	新股锁定	14.66	35.36	117	1,715.22	4,137.12	-
301632	广东建科	2025年8月5日	6个月	新股锁定	6.56	22.35	221	1,449.76	4,939.35	-
301636	泽润新能	2025年4月30日	6个月	新股锁定	33.06	54.65	53	1,752.18	2,896.45	-
301658	首航新能	2025年3月26日	6个月	新股锁定	11.80	35.10	210	2,478.00	7,371.00	-
301662	宏工科技	2025年4月10日	6个月	新股锁定	26.60	149.89	81	2,154.60	12,141.09	-
301665	泰禾股份	2025年4月2日	6个月	新股锁定	10.27	30.52	227	2,331.29	6,928.04	-
301678	新恒汇	2025年6月13日	6个月	新股锁定	12.80	67.70	128	1,638.40	8,665.60	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购，因此没有在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购，因此没有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为 ETF 基金，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现与跟踪指数相同的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司内部监督和反馈系统包括内部控制委员会、督察长、合规审计部、风险管理部、各部门负责人和风险控制联络人、各业务岗位。内部控制委员会负责对公司经营管理和基金运作中的风险进行评估并研究制订相应的控制制度。督察长向董事会负责，总管公司的内控事务并独立地就内控制度的执行情况履行检查、评价、报告和建议职能。风险管理部在督察长指导下对公司内部控制运行情况进行监控，主要针对公司内部控制制度的总体构架和内部控制的目标进行评估并提出改进意见；合规审计部在督察长的领导下对各部门和岗位的内部控制执行情况进行监督和核查，同时对内控的失控点进行查漏并责令改正。

本基金的基金管理人根据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的四层监控防线。第一层监控防线为一线岗位自控与互控；第二层防线为大业务板块内部各部门和部门之间的自控和互控；第三层监控防线为风险管理部和合规审计部对各岗位、各部门、各项业务全面实施的监督反馈；最后是以内部控制委员会为主体的第四层防线，实施对公司各类业务和风险的总体监督、控制，并对风险管理部和合规审计部的工作予以直接指导。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法是通过结合定性分析和定量分析方法，估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具的特征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定相应置信程度和风险损失的限度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款均存放于大型股份制商业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均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。

于本报告期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金净资产的比例较低（含债券投资比例为零），因此无重大信用风险。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险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。

于本报告期末，除附注中列示的卖出回购金融资产款将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。（上年度末：同）

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股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，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

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

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025年9月10日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	697,940.55	-	-	-	697,940.55
结算备付金	8,232.61	-	-	-	8,232.61
存出保证金	1,329.71	-	-	-	1,329.71
交易性金融资产	-	-	-	82,180,508.39	82,180,508.39
应收清算款	-	-	-	1,277,726.21	1,277,726.21
其他资产	-	-	-	46,027.12	46,027.12
资产总计	707,502.87	-	-	83,504,261.72	84,211,764.59
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	12,063.67	12,063.67
应付托管费	-	-	-	2,412.74	2,412.74
其他负债	-	-	-	121,861.45	121,861.45
负债总计	-	-	-	136,337.86	136,337.86
利率敏感度缺口	707,502.87	-	-	83,367,923.86	84,075,426.73
上年度末 2024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	2,019,805.36	-	-	-	2,019,805.36
结算备付金	3,115.15	-	-	-	3,115.15
存出保证金	1,756.25	-	-	-	1,756.25
交易性金融资产	-	-	-	105,203,933.01	105,203,933.01
资产总计	2,024,676.76	-	-	105,203,933.01	107,228,609.77
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	45,583.97	45,583.97
应付托管费	-	-	-	9,116.78	9,116.78
其他负债	-	-	-	155,768.38	155,768.38
负债总计	-	-	-	210,469.13	210,469.13
利率敏感度缺口	2,024,676.76	-	-	-104,993,463.88	107,018,140.64

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，以复制、跟踪深证创新 100 指数的方法为原则，根据标的指数成份股票在指数中的权重确定成份股票的买卖数量，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。在因特殊情况（如成份股停牌、流动性不足、法规法律限制等）导致无法获得足够数量的股票时，本基金可以根据市场情况，结合经验判断，综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股、备选成份股等进行替代，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。本基金采用完全复制法进行指数化投资，股票资产跟踪的标的指数为深证创新 100 指数，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资于深创 100 指数的成份股和备选成份股的资产比例不低于该基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量于国内依法发行上市的非成份股、债券、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025年9月10日		上年度末 2024年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	82,180,508.39	97.75	105,203,933.01	98.30
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	82,180,508.39	97.75	105,203,933.01	98.30

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025年9月10日）	上年度末（2024年12月31日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	4,122,463.87	5,254,902.37
	2. 业绩比较基准下降 5%	-4,122,463.87	-5,254,902.37

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025年9月10日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	82,074,705.16	105,082,734.44
第二层次	-	-
第三层次	105,803.23	121,198.57
合计	82,180,508.39	105,203,933.01

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的证券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关证券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义

的输入值所属的最低层次，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年9月10日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	121,198.57	121,198.57
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	129,124.50	129,124.50
转出第三层次	-	180,236.71	180,236.71
当期利得或损失总额	-	35,716.87	35,716.87
其中：计入损益的利得或损失	-	35,716.87	35,716.87
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	105,803.23	105,803.23
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	13,464.49	13,464.49
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	226,810.89	226,810.89
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	256,189.75	256,189.75
转出第三层次	-	287,690.61	287,690.61
当期利得或损失总额	-	-74,111.46	-74,111.46
其中：计入损益的利得或损失	-	-74,111.46	-74,111.46
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	121,198.57	121,198.57

期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动—公允价值变动损益	-	-28,870.84	-28,870.84
---	---	------------	------------

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	105,803.23	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0%-2896.12%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	121,198.57	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	47.68%~470.81%	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期末无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 8 投资组合报告（转型后）

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	62,798,103.22	98.49
	其中：股票	62,798,103.22	98.49
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-

	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	961,920.43	1.51
8	其他各项资产	1,414.58	0.00
9	合计	63,761,438.23	100.00

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

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

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,607,566.00	2.53
B	采矿业	301,692.00	0.47
C	制造业	51,482,715.06	80.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	204,544.00	0.32
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	216,975.00	0.34
G	交通运输、仓储和邮政业	870,323.00	1.37
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,490,381.00	2.34
J	金融业	5,245,084.00	8.25
K	房地产业	439,464.00	0.69
L	租赁和商务服务业	540,958.00	0.85
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	346,968.00	0.55
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-

	合计	62,746,670.06	98.70
--	----	---------------	-------

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	38,043.25	0.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	5,873.58	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	7,516.33	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	51,433.16	0.08

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	18,831	6,915,873.06	10.88
2	300308	中际旭创	6,280	3,830,800.00	6.03
3	300502	新易盛	6,500	2,800,720.00	4.41
4	000333	美的集团	35,300	2,758,695.00	4.34
5	300059	东方财富	93,900	2,176,602.00	3.42

6	002475	立讯精密	34,200	1,939,482.00	3.05
7	300274	阳光电源	10,880	1,860,915.20	2.93
8	002594	比亚迪	18,576	1,815,246.72	2.86
9	000858	五粮液	13,300	1,409,002.00	2.22
10	002371	北方华创	2,775	1,273,947.00	2.00
11	300476	胜宏科技	4,400	1,265,352.00	1.99
12	000651	格力电器	31,300	1,258,886.00	1.98
13	300124	汇川技术	14,400	1,084,752.00	1.71
14	000725	京东方 A	240,800	1,013,768.00	1.59
15	002714	牧原股份	18,300	925,614.00	1.46
16	000063	中兴通讯	23,100	874,104.00	1.37
17	002050	三花智控	15,600	862,836.00	1.36
18	300760	迈瑞医疗	4,400	837,980.00	1.32
19	002415	海康威视	26,900	802,696.00	1.26
20	002384	东山精密	9,200	778,780.00	1.22
21	000425	徐工机械	63,900	739,962.00	1.16
22	002463	沪电股份	9,900	723,393.00	1.14
23	002230	科大讯飞	14,100	709,089.00	1.12
24	000001	平安银行	61,500	701,715.00	1.10
25	002142	宁波银行	24,900	699,441.00	1.10
26	300498	温氏股份	40,400	681,952.00	1.07
27	002352	顺丰控股	17,400	666,768.00	1.05
28	000792	盐湖股份	23,600	664,576.00	1.05
29	300394	天孚通信	3,200	649,696.00	1.02
30	002028	思源电气	4,200	649,278.00	1.02
31	300014	亿纬锂能	9,700	637,872.00	1.00
32	000338	潍柴动力	37,000	636,400.00	1.00
33	000568	泸州老窖	5,400	627,588.00	0.99
34	000100	TCL 科技	132,000	599,280.00	0.94
35	002625	光启技术	11,500	560,740.00	0.88
36	002027	分众传媒	73,400	540,958.00	0.85
37	002241	歌尔股份	18,100	520,013.00	0.82
38	002460	赣锋锂业	8,100	509,409.00	0.80
39	000977	浪潮信息	7,400	492,840.00	0.78
40	000776	广发证券	20,500	451,410.00	0.71
41	300033	同花顺	1,400	451,052.00	0.71
42	000408	藏格矿业	5,200	438,880.00	0.69
43	300433	蓝思科技	14,200	429,834.00	0.68
44	002916	深南电路	1,800	418,122.00	0.66
45	300408	三环集团	9,100	416,325.00	0.65
46	002466	天齐锂业	7,400	409,812.00	0.64
47	002049	紫光国微	4,880	384,592.80	0.60
48	000625	长安汽车	31,500	373,590.00	0.59

49	002600	领益智造	22,900	355,866.00	0.56
50	300015	爱尔眼科	31,600	346,968.00	0.55
51	000938	紫光股份	13,200	324,720.00	0.51
52	000166	申万宏源	60,800	320,416.00	0.50
53	002311	海大集团	5,700	315,666.00	0.50
54	000538	云南白药	5,400	306,504.00	0.48
55	000157	中联重科	35,500	306,365.00	0.48
56	000975	山金国际	12,400	301,692.00	0.47
57	002179	中航光电	8,374	296,774.56	0.47
58	002001	新和成	11,300	284,647.00	0.45
59	002304	洋河股份	4,400	267,256.00	0.42
60	300442	润泽科技	5,000	264,000.00	0.42
61	002236	大华股份	13,800	261,372.00	0.41
62	002736	国信证券	19,900	261,088.00	0.41
63	300418	昆仑万维	6,200	258,540.00	0.41
64	002920	德赛西威	2,100	252,630.00	0.40
65	002422	科伦药业	8,400	246,540.00	0.39
66	000768	中航西飞	9,500	241,110.00	0.38
67	002938	鹏鼎控股	4,700	237,726.00	0.37
68	000002	万科A	48,800	226,920.00	0.36
69	002493	荣盛石化	19,100	223,661.00	0.35
70	002252	上海莱士	35,200	223,168.00	0.35
71	002648	卫星化学	12,600	222,768.00	0.35
72	002601	龙佰集团	11,100	217,338.00	0.34
73	000963	华东医药	5,500	216,975.00	0.34
74	001979	招商蛇口	24,600	212,544.00	0.33
75	000895	双汇发展	7,700	203,819.00	0.32
76	000661	长春高新	2,200	203,610.00	0.32
77	300661	圣邦股份	2,948	202,350.72	0.32
78	003816	中国广核	50,800	191,008.00	0.30
79	000617	中油资本	19,100	183,360.00	0.29
80	000301	东方盛虹	16,700	181,863.00	0.29
81	000786	北新建材	7,100	177,287.00	0.28
82	300866	安克创新	1,500	171,585.00	0.27
83	302132	中航成飞	2,000	158,000.00	0.25
84	300122	智飞生物	8,200	154,734.00	0.24
85	301269	华大九天	1,400	148,862.00	0.23
86	000876	新希望	15,400	141,988.00	0.22
87	300832	新产业	2,480	139,500.00	0.22
88	001965	招商公路	13,500	136,080.00	0.21
89	000596	古井贡酒	1,000	132,600.00	0.21
90	000999	华润三九	4,600	130,916.00	0.21
91	300896	爱美客	900	127,548.00	0.20

92	300628	亿联网络	3,500	124,775.00	0.20
93	300999	金龙鱼	4,100	117,834.00	0.19
94	300413	芒果超媒	4,500	109,890.00	0.17
95	000708	中信特钢	6,200	101,494.00	0.16
96	300765	新诺威	2,700	97,389.00	0.15
97	300979	华利集团	1,300	65,273.00	0.10
98	001391	国货航	6,500	38,480.00	0.06
99	001872	招商港口	1,500	28,995.00	0.05
100	001289	龙源电力	900	13,536.00	0.02

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	301656	联合动力	472	12,017.12	0.02
2	301584	建发致新	219	5,873.58	0.01
3	301632	广东建科	221	5,233.28	0.01
4	301609	山大电力	117	4,795.83	0.01
5	301491	汉桑科技	71	3,912.81	0.01
6	001221	悍高集团	60	3,416.40	0.01
7	301668	昊创瑞通	68	3,046.40	0.00
8	301575	艾芬达	55	2,725.25	0.00
9	301667	纳百川	47	2,682.29	0.00
10	301449	天溯计量	35	2,283.05	0.00
11	001233	海安集团	41	2,127.08	0.00
12	001388	信通电子	47	2,018.18	0.00
13	001369	双欣环保	101	1,301.89	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	300476	胜宏科技	1,461,624.00	2.30
2	002384	东山精密	785,345.00	1.24
3	002625	光启技术	648,880.00	1.02
4	000408	藏格矿业	405,420.00	0.64
5	300866	安克创新	185,416.00	0.29
6	300033	同花顺	144,879.00	0.23
7	000596	古井贡酒	108,895.00	0.17
8	300896	爱美客	101,054.00	0.16
9	300765	新诺威	98,495.00	0.15
10	002916	深南电路	90,967.00	0.14
11	301269	华大九天	82,035.00	0.13
12	300442	润泽科技	70,387.00	0.11
13	002920	德赛西威	68,156.00	0.11

14	300274	阳光电源	66,172.00	0.10
15	300308	中际旭创	62,902.00	0.10
16	300760	迈瑞医疗	59,651.00	0.09
17	002352	顺丰控股	57,433.00	0.09
18	300059	东方财富	53,398.00	0.08
19	000333	美的集团	51,450.00	0.08
20	300979	华利集团	50,036.00	0.08

注：买入金额不包括相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	511,679.00	0.80
2	300308	中际旭创	305,355.00	0.48
3	300759	康龙化成	235,639.00	0.37
4	300347	泰格医药	230,476.00	0.36
5	300782	卓胜微	186,263.00	0.29
6	300316	晶盛机电	174,582.00	0.27
7	300502	新易盛	170,637.00	0.27
8	002459	晶澳科技	162,820.00	0.26
9	000568	泸州老窖	152,554.00	0.24
10	000333	美的集团	143,324.00	0.23
11	000983	山西焦煤	133,349.00	0.21
12	002594	比亚迪	126,587.00	0.20
13	000792	盐湖股份	100,935.00	0.16
14	002475	立讯精密	88,593.00	0.14
15	000651	格力电器	81,520.00	0.13
16	002028	思源电气	78,321.00	0.12
17	301584	建发致新	72,358.68	0.11
18	300760	迈瑞医疗	71,657.40	0.11
19	000858	五粮液	67,465.00	0.11
20	300124	汇川技术	66,862.00	0.11

注：卖出金额不包括相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	5,800,320.69
卖出股票收入（成交）总额	4,741,068.05

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**8.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金未投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

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

基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚，无证券投资决策程序需特别说明。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,058.72
2	应收清算款	355.86
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,414.58

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	301656	联合动力	12,017.12	0.02	新股锁定
2	301584	建发致新	5,873.58	0.01	新股锁定
3	301632	广东建科	5,233.28	0.01	新股锁定
4	301609	山大电力	4,795.83	0.01	新股锁定
5	301491	汉桑科技	3,912.81	0.01	新股锁定

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，合计数可能不等于分项之和。

§ 8 投资组合报告（转型前）

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	82,180,508.39	97.59
	其中：股票	82,180,508.39	97.59
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	706,173.16	0.84
8	其他各项资产	1,325,083.04	1.57
9	合计	84,211,764.59	100.00

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

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

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	34,735,011.16	41.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,023,468.00	1.22
J	金融业	3,454,461.00	4.11
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	39,212,940.16	46.64

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,490,472.00	2.96
B	采矿业	562,205.00	0.67
C	制造业	29,403,483.85	34.97
D	电力、热力、燃气	301,033.00	0.36

	及水生产和供应业		
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	341,071.03	0.41
G	交通运输、仓储和邮政业	1,226,598.00	1.46
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,041,728.00	1.24
J	金融业	4,609,687.00	5.48
K	房地产业	830,674.00	0.99
L	租赁和商务服务业	881,820.00	1.05
M	科学研究和技术服务业	693,571.35	0.82
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	585,225.00	0.70
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	42,967,568.23	51.11

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	27,131	8,574,481.24	10.20
2	000333	美的集团	51,800	3,989,636.00	4.75
3	300308	中际旭创	9,080	3,495,800.00	4.16
4	300059	东方财富	131,900	3,454,461.00	4.11
5	002594	比亚迪	26,876	2,827,355.20	3.36
6	300274	阳光电源	15,380	1,973,254.00	2.35
7	300124	汇川技术	20,900	1,661,968.00	1.98
8	002371	北方华创	3,975	1,463,595.00	1.74
9	300760	迈瑞医疗	5,800	1,384,518.00	1.65
10	000063	中兴通讯	33,600	1,380,624.00	1.64

11	002415	海康威视	39,000	1,177,800.00	1.40
12	002230	科大讯飞	20,400	1,023,468.00	1.22
13	000338	潍柴动力	53,700	781,335.00	0.93
14	002050	三花智控	22,300	747,050.00	0.89
15	000977	浪潮信息	10,900	651,166.00	0.77
16	300433	蓝思科技	20,500	605,775.00	0.72
17	002028	思源电气	6,000	554,400.00	0.66
18	300408	三环集团	13,300	546,630.00	0.65
19	002049	紫光国微	6,880	518,614.40	0.62
20	002916	深南电路	2,600	476,606.00	0.57
21	002179	中航光电	12,074	469,920.08	0.56
22	002236	大华股份	20,100	364,614.00	0.43
23	002920	德赛西威	2,800	332,500.00	0.40
24	300661	圣邦股份	4,248	296,850.24	0.35
25	300832	新产业	3,480	235,944.00	0.28
26	300316	晶盛机电	6,500	224,575.00	0.27

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300502	新易盛	9,300	3,115,035.00	3.71
2	000858	五粮液	19,100	2,445,946.00	2.91
3	002475	立讯精密	49,300	2,370,837.00	2.82
4	000651	格力电器	45,900	1,889,244.00	2.25
5	002714	牧原股份	26,400	1,436,160.00	1.71
6	000725	京东方 A	349,300	1,425,144.00	1.70
7	000568	泸州老窖	7,900	1,102,682.00	1.31
8	300498	温氏股份	56,200	1,054,312.00	1.25
9	000001	平安银行	89,300	1,051,061.00	1.25
10	002142	宁波银行	36,100	1,037,153.00	1.23
11	002352	顺丰控股	23,100	972,048.00	1.16
12	300014	亿纬锂能	13,300	932,995.00	1.11
13	002463	沪电股份	14,200	901,416.00	1.07
14	002027	分众传媒	106,500	881,820.00	1.05
15	000425	徐工机械	87,300	861,651.00	1.02
16	000100	TCL 科技	191,600	837,292.00	1.00
17	300394	天孚通信	4,600	804,586.00	0.96
18	002241	歌尔股份	25,800	801,864.00	0.95
19	300033	同花顺	2,200	773,080.00	0.92
20	000792	盐湖股份	37,700	753,623.00	0.90
21	000776	广发证券	29,700	609,741.00	0.73
22	300015	爱尔眼科	45,900	585,225.00	0.70
23	000625	长安汽车	45,800	577,996.00	0.69
24	002460	赣锋锂业	11,800	555,190.00	0.66

25	002311	海大集团	8,200	527,014.00	0.63
26	000938	紫光股份	19,100	506,341.00	0.60
27	000002	万科A	70,800	485,688.00	0.58
28	002466	天齐锂业	10,800	474,444.00	0.56
29	000538	云南白药	7,900	469,497.00	0.56
30	002304	洋河股份	6,400	469,184.00	0.56
31	002422	科伦药业	12,200	462,136.00	0.55
32	000166	申万宏源	86,200	451,688.00	0.54
33	002600	领益智造	29,800	408,260.00	0.49
34	002736	国信证券	28,900	398,820.00	0.47
35	002001	新和成	16,400	397,864.00	0.47
36	000661	长春高新	3,200	390,240.00	0.46
37	000975	山金国际	18,000	379,620.00	0.45
38	000157	中联重科	51,500	375,950.00	0.45
39	300418	昆仑万维	9,000	366,300.00	0.44
40	002648	卫星化学	18,300	363,438.00	0.43
41	300347	泰格医药	5,600	359,632.00	0.43
42	002938	鹏鼎控股	6,900	356,040.00	0.42
43	002252	上海莱士	51,700	353,111.00	0.42
44	001979	招商蛇口	36,200	344,986.00	0.41
45	000768	中航西飞	13,700	340,171.00	0.40
46	000963	华东医药	8,000	338,320.00	0.40
47	300759	康龙化成	10,000	329,000.00	0.39
48	002601	龙佰集团	16,200	299,376.00	0.36
49	300896	爱美客	1,500	292,425.00	0.35
50	000617	中油资本	27,600	288,144.00	0.34
51	000895	双汇发展	11,200	287,280.00	0.34
52	300782	卓胜微	3,600	280,692.00	0.33
53	002493	荣盛石化	28,800	276,480.00	0.33
54	003816	中国广核	73,600	274,528.00	0.33
55	300442	润泽科技	5,100	264,792.00	0.31
56	000596	古井贡酒	1,500	261,555.00	0.31
57	300122	智飞生物	11,900	257,873.00	0.31
58	002459	晶澳科技	19,000	251,750.00	0.30
59	000301	东方盛虹	24,400	244,000.00	0.29
60	000786	北新建材	9,500	242,250.00	0.29
61	302132	中航成飞	2,900	233,711.00	0.28
62	000876	新希望	22,300	227,237.00	0.27
63	301269	华大九天	1,900	215,441.00	0.26
64	001965	招商公路	20,000	202,200.00	0.24
65	000999	华润三九	6,700	197,851.00	0.24
66	300999	金龙鱼	5,900	197,119.00	0.23
67	300413	芒果超媒	6,500	195,195.00	0.23

68	300628	亿联网络	5,000	191,450.00	0.23
69	000983	山西焦煤	26,500	182,585.00	0.22
70	000708	中信特钢	8,900	113,831.00	0.14
71	000877	天山股份	14,700	93,492.00	0.11
72	300979	华利集团	1,600	87,808.00	0.10
73	001872	招商港口	2,500	52,350.00	0.06
74	001289	龙源电力	1,500	26,505.00	0.03
75	301662	宏工科技	81	12,141.09	0.01
76	301535	浙江华远	505	10,933.25	0.01
77	301678	新恒汇	128	8,665.60	0.01
78	301658	首航新能	210	7,371.00	0.01
79	301479	弘景光电	79	7,335.15	0.01
80	301665	泰禾股份	227	6,928.04	0.01
81	301632	广东建科	221	4,939.35	0.01
82	301275	汉朔科技	88	4,762.56	0.01
83	301501	恒鑫生活	87	4,365.66	0.01
84	001382	新亚电缆	207	4,286.97	0.01
85	301609	山大电力	117	4,137.12	0.00
86	301595	太力科技	103	4,074.68	0.00
87	301590	优优绿能	20	3,980.80	0.00
88	301491	汉桑科技	71	3,672.83	0.00
89	301560	众捷汽车	94	3,316.32	0.00
90	301575	艾芬达	55	3,258.75	0.00
91	301636	泽润新能	53	2,896.45	0.00
92	001335	信凯科技	69	2,751.03	0.00
93	001221	悍高集团	60	2,338.20	0.00
94	001390	古麒绒材	75	1,919.25	0.00
95	001388	信通电子	47	1,729.13	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300059	东方财富	6,502,311.00	6.08
2	300502	新易盛	3,117,346.00	2.91
3	000858	五粮液	2,449,552.00	2.29
4	002475	立讯精密	2,336,221.00	2.18
5	000651	格力电器	1,891,887.00	1.77
6	002714	牧原股份	1,432,193.00	1.34
7	000725	京东方 A	1,425,616.00	1.33
8	300750	宁德时代	1,416,099.60	1.32
9	000568	泸州老窖	1,101,819.00	1.03
10	300498	温氏股份	1,050,449.00	0.98
11	000001	平安银行	1,049,354.00	0.98

12	002142	宁波银行	1,044,552.00	0.98
13	002352	顺丰控股	969,985.00	0.91
14	300014	亿纬锂能	938,323.00	0.88
15	002463	沪电股份	891,854.00	0.83
16	002027	分众传媒	884,403.00	0.83
17	000425	徐工机械	864,553.00	0.81
18	002241	歌尔股份	838,517.00	0.78
19	000100	TCL 科技	837,645.00	0.78
20	300394	天孚通信	803,234.00	0.75

注：买入金额不包括相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	4,190,124.00	3.92
2	000333	美的集团	3,286,879.00	3.07
3	002594	比亚迪	2,477,099.00	2.31
4	300308	中际旭创	2,413,544.00	2.26
5	300059	东方财富	2,155,256.00	2.01
6	002241	歌尔股份	1,453,294.00	1.36
7	002371	北方华创	1,426,027.00	1.33
8	300274	阳光电源	1,348,560.00	1.26
9	300760	迈瑞医疗	1,224,406.00	1.14
10	002625	光启技术	1,204,086.00	1.13
11	300124	汇川技术	1,163,343.00	1.09
12	300450	先导智能	1,130,755.00	1.06
13	000063	中兴通讯	1,110,287.00	1.04
14	002415	海康威视	1,016,000.00	0.95
15	002074	国轩高科	962,042.00	0.90
16	002456	欧菲光	907,945.00	0.85
17	002837	英维克	793,854.00	0.74
18	300454	深信服	792,815.16	0.74
19	000066	中国长城	764,748.00	0.71
20	002230	科大讯飞	764,398.00	0.71

注：卖出金额不包括相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	59,715,153.86
卖出股票收入（成交）总额	58,613,767.91

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**8.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金未投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

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

基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚，无证券投资决策程序需特别说明。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,329.71
2	应收清算款	1,277,726.21
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	46,027.12
8	其他	-
9	合计	1,325,083.04

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，合计数可能不等于分项之和。

§9 基金份额持有人信息（转型后）

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
1,732	34,449.61	8,900,532.00	14.92	50,766,200.00	85.08

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	广发证券股份有限公司	3,759,257.00	6.30
2	中信建投证券股份有限公司	1,614,476.00	2.71
3	李斌	1,499,102.00	2.51
4	郑云波	1,335,101.00	2.24
5	中国国际金融股份有限公司	1,099,066.00	1.84
6	芮荣喜	1,000,145.00	1.68
7	黄勇	1,000,087.00	1.68
8	白玉	1,000,077.00	1.68
9	周艳贞	1,000,019.00	1.68
10	中信证券股份有限公司	981,601.00	1.65

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

§ 9 基金份额持有人信息（转型前）

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
2,463	33,969.44	7,731,648.00	9.24	75,935,084.00	90.76

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	广发证券股份有限公司	3,501,431.00	4.18
2	中信建投证券股份有限公司	1,760,762.00	2.10
3	李斌	1,499,102.00	1.79
4	中国国际金融股份有限公司	1,380,880.00	1.65
5	郑云波	1,335,101.00	1.60
6	芮荣喜	1,000,145.00	1.20
7	黄勇	1,000,087.00	1.20
8	高其相	1,000,077.00	1.20
9	白玉	1,000,077.00	1.20
10	周艳贞	1,000,019.00	1.20

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

§ 10 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

基金合同生效日（2025年9月11日） 基金份额总额	83,666,732.00
基金合同生效日起至报告期期末基金 总申购份额	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金 总赎回份额	24,000,000.00
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	59,666,732.00

注：本基金合同生效日于 2025 年 09 月 11 日。

§ 10 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

基金合同生效日（2021 年 6 月 18 日） 基金份额总额	829,666,732.00
本报告期期初基金份额总额	135,666,732.00
本报告期基金总申购份额	58,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	110,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	83,666,732.00

注：本基金合同生效日于 2021 年 06 月 18 日。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金以通讯开会方式召开了基金份额持有人大会，大会表决投票时间自 2025 年 8 月 4 日起至 2025 年 8 月 22 日 17:00 止，会议审议通过了《关于华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金转型及修改基金合同等有关事项的议案》。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

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

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

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

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

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，聘任边济东先生为资产托管部总经理。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人基金管理业务、基金财产和基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所在本报告期的审计报酬为 15,000.00 元人民币。目前该会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：2024 年 10 月 23 日起至本报告期末。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人无相关情况。

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人相关从业人员无相关情况。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型后)

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
招商证券	4	7,903,805.80	75.59	1,469.66	75.60	-
中信建投	2	2,385,031.18	22.81	443.34	22.81	-
中金国际	2	110,640.32	1.06	20.55	1.06	-
金融街证券	2	35,105.50	0.34	6.50	0.33	-
华泰证券	3	20,908.25	0.20	3.92	0.20	-
财通证券	3	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
诚通证券	1	-	-	-	-	-
大和证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-

方正证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	4	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国联民生	5	-	-	-	-	-
国泰海通	3	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
华兴证券	2	-	-	-	-	-
华源证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
麦高证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	3	-	-	-	-	-
太平洋证 券	1	-	-	-	-	-
天风证券	3	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	3	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	5	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
中邮证券	1	-	-	-	-	-
甬兴证券	2	-	-	-	-	-

注：1、基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

(1) 选择标准：资金雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中

国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需
要，并能为本基金提供全面的信息服
务；研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；适当的地域分散化。

(2) 选择程序:根据证监会《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》和公司《公募基金及私募资产管理计划专用交易席位管理办法》的要求，公司与符合前述标准的证券公司，签订《证券交易单元租用协议》，参与证券交易。

2、本报告期租用的证券公司交易单元均为新增。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期内未租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型前)

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
华泰证券	3	75,005,455.84	63.66	13,944.81	63.90	-
华宝证券	1	25,123,182.90	21.32	4,595.96	21.06	-
招商证券	4	12,022,290.25	10.20	2,234.65	10.24	-
山西证券	2	1,628,454.94	1.38	299.58	1.37	-
中信证券	5	1,217,242.13	1.03	226.27	1.04	-
申港证券	1	946,988.83	0.80	173.21	0.79	-
麦高证券	1	766,159.16	0.65	140.19	0.64	-
国元证券	2	492,596.10	0.42	91.68	0.42	-
长城证券	2	455,503.64	0.39	84.69	0.39	-
中金国际	2	139,225.55	0.12	25.88	0.12	-
华安证券	2	30,986.17	0.03	5.76	0.03	-
财通证券	3	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
诚通证券	1	-	-	-	-	-
大和证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-

第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	4	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国联民生	5	-	-	-	-	-
国泰海通	3	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
华兴证券	2	-	-	-	-	-
华源证券	2	-	-	-	-	-
金融街证 券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	3	-	-	-	-	-
太平洋证 券	1	-	-	-	-	-
天风证券	3	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	3	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
中邮证券	1	-	-	-	-	-
甬兴证券	2	-	-	-	-	-

注：1、基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

(1)选择标准: 资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；财务状况良好，各项财

务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需，并能为本基金提供全面的信息服；研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；适当的地域分散化。

(2) 选择程序:根据证监会《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》和公司《公募基金及私募资产管理计划专用交易席位管理办法》的要求，公司与符合前述标准的证券公司，签订《证券交易单元租用协议》，参与证券交易。

2、本报告期租用的证券公司交易单元新增的有：国投证券、华泰证券、华西证券、浙商证券、中信证券；退租交易单元：长城证券、国联民生证券、中信证券、甬兴证券。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期内未租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

11.8 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华宝基金关于旗下部分交易型开放式指数证券投资基金新增西南证券股份有限公司为一级交易商的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2025-01-17
2	华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2025-01-22
3	华宝基金管理有限公司关于以通讯方式召开华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告	基金管理人网站, 中国证券报	2025-03-17
4	华宝基金管理有限公司关于以通讯方式召开华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	基金管理人网站, 中国证券报	2025-03-18
5	华宝基金管理有限公司关于以通讯方式召开华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	基金管理人网站, 中国证券报	2025-03-19
6	华宝基金管理有限公司关于华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	基金管理人网站, 中国证券报	2025-03-25
7	华宝基金管理有限公司关于调整证券投资基金主流流动性服务商的公告	基金管理人网站, 中国证券报	2025-03-26

8	华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年年度报告	基金管理人网站	2025-03-31
9	华宝基金关于旗下部分交易型开放式指数证券投资基金新增东吴证券股份有限公司为一级交易商的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2025-04-09
10	关于华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会计票日停牌的提示性公告	基金管理人网站, 中国证券报	2025-04-21
11	华宝基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法调整的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2025-04-22
12	华宝基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2025-04-22
13	华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2025-04-22
14	华宝基金管理有限公司关于华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告	基金管理人网站, 中国证券报	2025-04-22
15	华宝基金关于旗下部分交易型开放式指数证券投资基金新增万和证券股份有限公司为一级交易商的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2025-06-10
16	华宝基金管理有限公司关于旗下部分基金流动性服务商终止的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2025-06-26
17	华宝基金管理有限公司关于以通讯方式二次召开华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告	基金管理人网站, 中国证券报	2025-07-21
18	华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 2 季度报告	基金管理人网站	2025-07-21
19	华宝基金管理有限公司关于以通讯方式二次召开华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	基金管理人网站, 中国证券报	2025-07-22
20	华宝基金管理有限公司关于以通讯方式二次召开华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	基金管理人网站, 中国证券报	2025-07-23
21	华宝基金关于旗下部分交易型开放式指数证券投资基金新增金元证券股份有限公司为一级交易商的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2025-08-12
22	关于华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会	基金管理人网站, 中国证券报	2025-08-25

	会计票日停牌的提示性公告		
23	华宝基金管理有限公司关于华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会（二次召开）表决结果暨决议生效的公告	基金管理人网站, 中国证券报	2025-08-26
24	华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年中期报告	基金管理人网站	2025-08-29
25	华宝基金管理有限公司关于华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金实施转型的公告	基金管理人网站, 中国证券报	2025-09-02
26	华宝基金管理有限公司关于华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金实施转型的第一次提示性公告	基金管理人网站, 中国证券报	2025-09-05
27	华宝基金管理有限公司关于华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金实施转型的第二次提示性公告	基金管理人网站, 中国证券报	2025-09-08
28	华宝基金管理有限公司关于华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金停牌及暂停办理申购赎回业务的提示性公告	基金管理人网站, 中国证券报	2025-09-09
29	华宝深证 100 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书	基金管理人网站	2025-09-11
30	华宝基金管理有限公司关于华宝深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效暨基金更名、复牌及恢复办理申购赎回业务的公告	基金管理人网站, 中国证券报	2025-09-11
31	华宝深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站	2025-09-11
32	华宝深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同	基金管理人网站	2025-09-11
33	华宝深证 100 交易型开放式指数证券投资基金托管协议	基金管理人网站	2025-09-11
34	华宝基金关于旗下部分交易型开放式指数证券投资基金新增甬兴证券有限公司为一级交易商的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2025-09-15
35	华宝深证 100 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 3 季度报告	基金管理人网站	2025-10-28
36	华宝基金关于旗下部分交易型开放式指数证券投资基金新增瑞银证券有限责任公司为一级交易商的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2025-11-18
37	华宝基金管理有限公司关于旗下部分基金增加流动性服务商的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2025-11-24
38	华宝基金管理有限公司关于旗下部分	基金管理人网站, 上海	2025-12-31

	基金增加流动性服务商的公告	证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	
--	---------------	------------------------	--

11.8 其他重大事件（转型前）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华宝基金关于旗下部分交易型开放式指数证券投资基金新增西南证券股份有限公司为一级交易商的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2025-01-17
2	华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2025-01-22
3	华宝基金管理有限公司关于以通讯方式召开华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告	基金管理人网站, 中国证券报	2025-03-17
4	华宝基金管理有限公司关于以通讯方式召开华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	基金管理人网站, 中国证券报	2025-03-18
5	华宝基金管理有限公司关于以通讯方式召开华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	基金管理人网站, 中国证券报	2025-03-19
6	华宝基金管理有限公司关于华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	基金管理人网站, 中国证券报	2025-03-25
7	华宝基金管理有限公司关于调整证券投资基金主流流动性服务商的公告	基金管理人网站, 中国证券报	2025-03-26
8	华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年年度报告	基金管理人网站	2025-03-31
9	华宝基金关于旗下部分交易型开放式指数证券投资基金新增东吴证券股份有限公司为一级交易商的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2025-04-09
10	关于华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会会计票日停牌的提示性公告	基金管理人网站, 中国证券报	2025-04-21
11	华宝基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2025-04-22
12	华宝基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法调整的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2025-04-22
13	华宝基金管理有限公司关于华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告	基金管理人网站, 中国证券报	2025-04-22
14	华宝深证创新 100 交易型开放式指数	基金管理人网站	2025-04-22

	证券投资基金 2025 年第 1 季度报告		
15	华宝基金关于旗下部分交易型开放式指数证券投资基金新增万和证券股份有限公司为一级交易商的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2025-06-10
16	华宝基金管理有限公司关于旗下部分基金流动性服务商终止的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2025-06-26
17	华宝基金管理有限公司关于以通讯方式二次召开华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告	基金管理人网站, 中国证券报	2025-07-21
18	华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 2 季度报告	基金管理人网站	2025-07-21
19	华宝基金管理有限公司关于以通讯方式二次召开华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	基金管理人网站, 中国证券报	2025-07-22
20	华宝基金管理有限公司关于以通讯方式二次召开华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	基金管理人网站, 中国证券报	2025-07-23
21	华宝基金关于旗下部分交易型开放式指数证券投资基金新增金元证券股份有限公司为一级交易商的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2025-08-12
22	关于华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会计票日停牌的提示性公告	基金管理人网站, 中国证券报	2025-08-25
23	华宝基金管理有限公司关于华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会(二次召开)表决结果暨决议生效的公告	基金管理人网站, 中国证券报	2025-08-26
24	华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年中期报告	基金管理人网站	2025-08-29
25	华宝基金管理有限公司关于华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金实施转型的公告	基金管理人网站, 中国证券报	2025-09-02
26	华宝基金管理有限公司关于华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金实施转型的第一次提示性公告	基金管理人网站, 中国证券报	2025-09-05
27	华宝基金管理有限公司关于华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金实施转型的第二次提示性公告	基金管理人网站, 中国证券报	2025-09-08
28	华宝基金管理有限公司关于华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资	基金管理人网站, 中国证券报	2025-09-09

	基金停牌及暂停办理申购赎回业务的提示性公告		
--	-----------------------	--	--

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于 2025 年 03 月 17 日发布华宝基金管理有限公司关于以通讯方式召开华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告，于 2025 年 03 月 17 日发布华宝基金管理有限公司关于以通讯方式召开华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告，于 2025 年 04 月 22 日发布华宝基金管理有限公司关于华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告，于 2025 年 07 月 21 日发布华宝基金管理有限公司关于以通讯方式二次召开华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告，于 2025 年 07 月 22 日发布华宝基金管理有限公司关于以通讯方式二次召开华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告，于 2025 年 08 月 26 日发布华宝基金管理有限公司关于华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会（二次召开）表决结果暨决议生效的公告，具体内容详见公司公告，请投资者予以关注。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；
 华宝深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同；
 华宝深证 100 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书；
 华宝深证 100 交易型开放式指数证券投资基金托管协议；
 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
 基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；
 基金托管人业务资格批件和营业执照。

13.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

13.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝基金管理有限公司

2026 年 3 月 31 日