华宝中证A500交易型开放式指数证券投资基金
2026年中期报告

2026年6月30日

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2026年8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。本中期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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
§4 管理人报告 8
4.1 基金管理人及基金经理情况 8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10
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 10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 12
§5 托管人报告 12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 12
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 12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 12
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 12
6.1 资产负债表 12
6.2 利润表 14
6.3 净资产变动表 15
6.4 报表附注 17
§7 投资组合报告 38
7.1 期末基金资产组合情况 38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 54
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 54
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 55
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 55

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 55
7.12 投资组合报告附注 55

§8 基金份额持有人信息 56

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 57
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 57

§9 开放式基金份额变动 57

§10 重大事件揭示 57

10.1 基金份额持有人大会决议 57
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 57
10.4 基金投资策略的改变 57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 57
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 58
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 58
10.8 其他重大事件 59

§11 影响投资者决策的其他重要信息 59

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 60

§12 备查文件目录 60

12.1 备查文件目录 60
12.2 存放地点 60
12.3 查阅方式 60

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华宝中证 A500ETF
场内简称	A500ETF 华宝
基金主代码	563500
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 11 月 22 日
基金管理人	华宝基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	657,958,712.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2024 年 12 月 2 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。 对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将通过投资成份股、非成份股、成份股个股衍生品等进行替代。
业绩比较基准	中证 A500 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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周雷	冯萌
	联系电话	021-38505888	021-52629999-213310
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	fengmeng@cib.com.cn
客户服务电话		400-700-5588、400-820-5050	95561
传真		021-38505777	021-62159217
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	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦

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	上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼
邮政编码	200120	200120
法定代表人	夏雪松	吕家进

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
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金中期报告置备地点	基金管理人办公场所和基金托管人办公场所。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	83,356,506.48
本期利润	64,451,804.89
加权平均基金份额本期利润	0.0829
本期加权平均净值利润率	12.73%
本期基金份额净值增长率	14.59%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	128,465,294.15
期末可供分配基金份额利润	0.1952
期末基金资产净值	464,002,986.09
期末基金份额净值	0.7052
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	46.03%

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。

3.2 基金净值表现

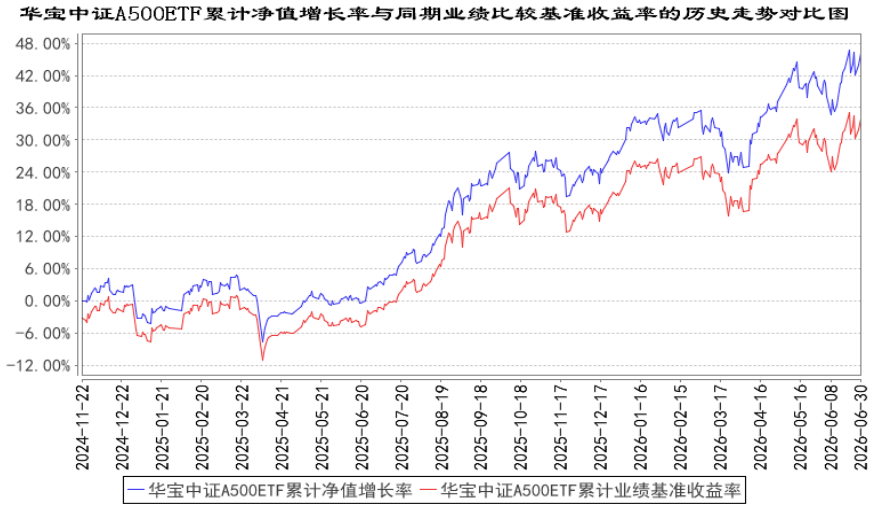
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	16.52%	1.40%	14.26%	1.41%	2.26%	-0.01%
过去六个月	14.59%	1.28%	11.91%	1.29%	2.68%	-0.01%
过去一年	41.97%	1.14%	36.38%	1.14%	5.59%	0.00%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	46.03%	1.10%	33.88%	1.13%	12.15%	-0.03%

注：（1）基金业绩基准：中证 A500 指数收益率；

（2）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：按照基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定，截至 2025 年 05 月 22 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

§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（2026 年 06 月 30 日），本公司正在管理运作的公开募集证券投资基金共 178 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

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	2024-11-22	-	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，现任指数研发投资部副总经理。2020 年 7 月至 2026 年 5 月任华宝中证电子 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 月至 2026 年 5 月任华宝中证电子 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 月至 2026 年 4 月任华宝深证 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，2026 年 4 月起任华宝创业板人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华宝创业板人工智能交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2026 年 4 月起任华宝深证 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。

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

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

4.1.3 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

本报告期内，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝中证 A500 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 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，本基金没有发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 上半年，全球宏观环境受地缘冲突、通胀反弹等因素扰动，中国经济则顶住外部压力，实现稳中向好发展态势。新动能对经济增长贡献率不断提升，人工智能、AI 算力、创新药等实现快速发展。在政策呵护市场，叠加流动性宽松背景下，市场整体走势良好，但结构性分化也很明显。市场方面，2026 上半年，电子、通信、建筑材料、机械设备等行业表现较好，保险、农牧渔、食品饮料、钢铁等行业表现相对较弱。本报告期中，以沪深 300 指数和中证 A500 为代表的大盘蓝筹股指数分别上涨了 7.55%和 11.91%；而作为成长股代表的创业板指数上涨了 35.58%。在本报告期中，中证 A500 指数累计上涨了 11.91%。

本报告期本基金为正常运作期，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

本报告期基金份额净值增长率为 14.59%，业绩比较基准收益率为 11.91%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济与市场方面，展望 2026 下半年，国内经济将延续复苏态势，整体保持平稳增长。其中出口仍是重要支撑，全球 AI 资本开支扩张、能源转型两大超级周期持续赋能。内需修复相对偏慢，地产仍处于筑底阶段，居民消费、传统服务业修复节奏平缓。预计“稳增长”仍然是国内经济政策的主要目标，国内将进一步扩大内需，加快推动经济转型升级，以高质量发展的确定性应对外部环境的不确定性。权益资产仍蕴含较多投资机会，但市场波动和轮动也可能加剧。中证 A500 指数从各行业选取市值较大、流动性较好的 500 只证券作为指数样本，以反映各行业最具代表性上市公司证券的整体表现。

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，实现对中证 A500 指数的有效跟踪。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据法律法规及基金合同的规定，本基金于 2026 年 2 月 11 日发布了分红公告，本次分红为 2026 年度的第 1 次分红。本基金向 2026 年 2 月 13 日在本基金注册登记机构登记在册的基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.047 元，利润分配合计为人民币 4,417,806.01 元，其中现

金形式发放总额为人民币 4,417,806.01 元，再投资形式发放总额为人民币 0 元。本基金于 2026 年 5 月 15 日发布了分红公告，本次分红为 2026 年度的第 2 次分红。本基金向 2026 年 5 月 19 日在本基金注册登记机构登记在册的基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.013 元，利润分配合计为人民币 785,146.67 元，其中现金形式发放总额为人民币 785,146.67 元，再投资形式发放总额为人民币 0 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，本托管人根据自身能够获取的数据和信息，依据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人根据自身能够获取的数据和信息，认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	1,663,086.20	1,388,678.92
结算备付金		5,250,404.82	4,454,028.76
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	457,878,591.69	611,759,436.71
其中：股票投资		457,878,591.69	611,759,436.71
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
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		16,353.38	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	60,492.63	-
资产总计		464,868,928.72	617,602,144.39
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026 年 6 月 30 日**	**上年度末 2025 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	13,499.02
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		53,858.22	83,850.24
应付托管费		17,952.77	27,950.09
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		13.07	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-

其他负债	6.4.7.6	794,118.57	172,492.20
负债合计		865,942.63	297,791.55
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	328,979,356.00	496,979,355.99
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	135,023,630.09	120,324,996.85
净资产合计		464,002,986.09	617,304,352.84
负债和净资产总计		464,868,928.72	617,602,144.39

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.7052 元，基金份额总额 657,958,712.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		65,099,368.10	56,286,730.60
1.利息收入		3,733.20	30,155.83
其中：存款利息收入	6.4.7.9	3,733.20	30,155.83
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）		84,164,726.21	35,510,208.40
其中：股票投资收益	6.4.7.10	80,472,975.31	17,678,321.86
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	3,691,750.90	17,831,886.54
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）	6.4.7.16	-18,904,701.59	18,965,632.38
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-164,389.72	1,780,733.99
减：二、营业总支出		647,563.21	1,919,982.03
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	378,372.90	1,313,486.88
其中：暂估管理人报酬		-	-
2．托管费	6.4.10.2.2	126,124.31	437,828.97
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	6.4.7.18	-	-
7．税金及附加		1.40	-
8．其他费用	6.4.7.19	143,064.60	168,666.18
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		64,451,804.89	54,366,748.57
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		64,451,804.89	54,366,748.57
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		64,451,804.89	54,366,748.57

6.3 净资产变动表

会计主体：华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	496,979,355.99	-	120,324,996.85	617,304,352.84
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本期期初净资产	496,979,355.99	-	120,324,996.85	617,304,352.84
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-167,999,999.99	-	14,698,633.24	-153,301,366.75
（一）、综合收益总额	-	-	64,451,804.89	64,451,804.89
（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）	-167,999,999.99	-	-44,550,218.97	-212,550,218.96
其中：1.基金申购款	195,000,000.02	-	63,187,869.41	258,187,869.43
2.基金赎回款	-363,000,000.01	-	-107,738,088.38	-470,738,088.39
（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）	-	-	-5,202,952.68	-5,202,952.68
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	328,979,356.00	-	135,023,630.09	464,002,986.09

项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,972,979,356.00	-	23,011,392.49	1,995,990,748.49
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,972,979,356.00	-	23,011,392.49	1,995,990,748.49
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-717,000,000.00	-	8,149,713.61	-708,850,286.39

（一）、综合收益总额	-	-	54,366,748.57	54,366,748.57
（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）	-717,000,000.00	-	-40,804,011.19	-757,804,011.19
其中：1.基金申购款	1,431,000,000.00	-	-20,150,996.56	1,410,849,003.44
2. 基金赎回款	-2,148,000,000.00	-	-20,653,014.63	-2,168,653,014.63
（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）	-	-	-5,413,023.77	-5,413,023.77
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,255,979,356.00	-	31,161,106.10	1,287,140,462.10

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系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[2024]1526 号文《关于准予华宝中证 A500 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于 2024 年 11 月 5 日至 2024 年 11 月 18 日止期间向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2024）验字第 70072895_B05 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2024 年 11 月 22 日生效。本基金为交易型开放式，存续期限不定。设立时募

集扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 1,999,953,201.00 元（含募集股票市值）；在募集期间产生利息为人民币 455,131.97 元（人民币 428,976.97 元归入基金财产）。以上共募集资产总额为人民币 2,000,408,332.97 元，折合 1,999,979,356.00 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，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝中证 A500 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、债券回购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转融通证券出借业务和融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即中证 A500 指数收益率。

本财务报表已于 2026 年 8 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照企业会计准则及其应用指南、准则解释及其他相关规定（包括《资产管理产品相关会计处理规定》）（以下统称企业会计准则）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》、《证券投资基金会计核算业务指引》、基金合同和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的

财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《财政部　税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	1,663,086.20
等于：本金	1,662,973.18
加：应计利息	113.02
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	1,663,086.20

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		383,274,988.18	-	457,878,591.69	74,603,603.51
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		383,274,988.18	-	457,878,591.69	74,603,603.51

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。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 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。

6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	60,492.63
合计	60,492.63

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	83,308.87
应退替代款	642,383.84
可退替代款	54,309.51
其他	14,116.35
合计	794,118.57

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	993,958,712.00	496,979,355.99
本期申购	390,000,000.00	195,000,000.02
本期赎回（以“-”号填列）	-726,000,000.00	-363,000,000.01
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	657,958,712.00	328,979,356.00

6.4.7.8 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	88,983,540.69	31,341,456.16	120,324,996.85
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	88,983,540.69	31,341,456.16	120,324,996.85
本期利润	83,356,506.48	-18,904,701.59	64,451,804.89
本期基金份额交易产生的变动数	-38,671,800.34	-5,878,418.63	-44,550,218.97
其中：基金申购款	59,088,745.19	4,099,124.22	63,187,869.41
基金赎回款	-97,760,545.53	-9,977,542.85	-107,738,088.38
本期已分配利润	-5,202,952.68	-	-5,202,952.68
本期末	128,465,294.15	6,558,335.94	135,023,630.09

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,795.76
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	937.44
其他	-
合计	3,733.20

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	58,117,549.35
股票投资收益——赎回差价收入	22,355,425.96
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	80,472,975.31

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	293,926,506.04
减：卖出股票成本总额	235,540,288.16
减：交易费用	268,668.53
买卖股票差价收入	58,117,549.35

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
赎回基金份额对价总额	470,738,088.39
减：现金支付赎回款总额	226,563,373.39
减：赎回股票成本总额	221,819,289.04
减：交易费用	-
赎回差价收入	22,355,425.96

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 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。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 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。

6.4.7.13 贵金属投资收益

6.4.7.13.1 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。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 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。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,691,750.90
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	3,691,750.90

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-18,904,701.59
股票投资	-18,904,701.59
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	-18,904,701.59

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	-164,389.72
合计	-164,389.72

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。

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	13,884.51
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	248.36
IOPV 计算与发布费用	9,916.99
注册登记费用	59,507.37
合计	143,064.60

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于 2026 年 8 月 12 日宣告收益分配基准日为 2026 年 7 月 31 日的分红，向截至 2026 年 8 月 14 日止在本基金注册登记机构登记在册的份额持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.1120 元。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华宝基金管理有限公司("华宝基金")	基金管理人
兴业银行股份有限公司("兴业银行")	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
华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金("华宝中证 A500ETF 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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	378,372.90	1,313,486.88
其中：应支付销售机构的客户维护费	33,836.11	152,886.35
应支付基金管理人的净管理费	344,536.79	1,160,600.53

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 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值 ×0.15% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	126,124.31	437,828.97

注：支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05%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 × 0.05% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
兴业银行股份有限公司－华宝中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金	329,080,200.00	50.02	419,399,500.00	42.19

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行	1,663,086.20	2,795.76	4,618,926.43	18,087.30

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期末本基金持有 119,000 股宝钢股份,期末公允价值为人民币 646,170 元,占本基金期末基金资产净值比例为 0.14%。(上年度末:本基金持有 184,900 股宝钢股份，期末公允价值为人民币 1,377,505 元,占本基金期末基金资产净值比例为 0.22%。）本报告期末本基金持有 46,700 股中国太保,期末公允价值为人民币 1,331,884 元,占本基金期末基金资产净值比例为 0.29%。(上年度末:本基金持有 73,100 股中国太保，期末公允价值为人民币 3,063,621 元,占本基金期末基金资产净值比例为 0.50%。）本报告期末本基金持有 231,400 股兴业银行,期末公允价值为人民币 3,831,984 元,占本基金期末基金资产净值比例为 0.83%。(上年度末:本基金持有 358,300 股兴业银行，期末公允价值为人民币 7,545,798 元,占本基金期末基金资产净值比例为 1.22%。）

除以上情况外，无其他需要说明的关联方交易事项。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2026 年 2 月 13 日	2026 年 2 月 24 日	-	0.0470	4,417,806.01	-	4,417,806.01	-
2	2026 年 5 月 19 日	2026 年 5 月 20 日	-	0.0130	785,146.67	-	785,146.67	-
合计	-	-	-	0.0600	5,202,952.68	-	5,202,952.68	-

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001220	世盟	2026 年 1	6 个月	新股	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-

	股份	月 27 日		锁定						
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定	53.26	58.74	163	8,681.38	9,574.62	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股锁定	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001365	天海电子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	新股锁定	27.19	31.31	396	10,767.24	12,398.76	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定	10.12	27.73	2,083	21,079.96	57,761.59	-
301513	尚水智能	2026 年 4 月 10 日	6 个月	新股锁定	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春光集团	2026 年 4 月 28 日	6 个月	新股锁定	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026 年 4 月 22 日	6 个月	新股锁定	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新股锁定	46.08	463.33	706	32,532.48	327,110.98	-
301669	高特电子	2026 年 6 月 2 日	6 个月	新股锁定	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301680	固德	2026 年 2	6 个月	新股	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-

	电材	月 27 日		锁定						
301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股锁定	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股锁定	11.18	17.59	533	5,958.94	9,375.47	-
603284	林平发展	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股锁定	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股锁定	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股锁定	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603407	长裕集团	2026 年 4 月 29 日	6 个月	新股锁定	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	新股锁定	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688712	北芯	2026 年 1	6 个月	新股	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-

	生命	月 28 日		锁定						
688759	必贝特	2025 年 10 月 21 日	9 个月	新股锁定	17.78	30.65	12,552	223,174.56	384,718.80	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁定	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688790	昂瑞微	2025 年 12 月 9 日	9 个月	新股锁定	83.06	126.45	1,913	158,893.78	241,898.85	-
688795	摩尔线程	2025 年 11 月 26 日	9 个月	新股锁定	114.28	676.94	2,560	292,556.80	1,732,966.40	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定	44.56	468.67	154	6,862.24	72,175.18	-
688802	沐曦股份	2025 年 12 月 9 日	9 个月	新股锁定	104.66	768.89	1,764	184,620.24	1,356,321.96	-
688808	联讯仪器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新股锁定	81.88	1,584.33	107	8,761.16	169,523.31	-
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股锁定	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股锁定	9.47	70.14	1,693	16,032.71	118,747.02	-
688820	盛合	2026 年 4	6 个月	新股	19.68	141.49	659	12,969.12	93,241.91	-

	晶微	月 13 日		锁定						

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	832.00	2026 年 7 月 13 日	890.99	2,687	715,283.25	2,235,584.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.12.4 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为 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。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。 本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款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通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在场外交易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(上年度末：同)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于本报告期末，本基金所承担的其他金融负债的合约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）

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,663,086.20	-	-	-	1,663,086.20
结算备付金	5,250,404.82	-	-	-	5,250,404.82
交易性金融资产	-	-	-	457,878,591.69	457,878,591.69
应收清算款	-	-	-	16,353.38	16,353.38
其他资产	-	-	-	60,492.63	60,492.63
资产总计	6,913,491.02	-	-	457,955,437.70	464,868,928.72
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	53,858.22	53,858.22
应付托管费	-	-	-	17,952.77	17,952.77
应交税费	-	-	-	13.07	13.07
其他负债	-	-	-	794,118.57	794,118.57
负债总计	-	-	-	865,942.63	865,942.63
利率敏感度缺口	6,913,491.02	-	-	457,089,495.07	464,002,986.09
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,388,678.92	-	-	-	1,388,678.92
结算备付金	4,454,028.76	-	-	-	4,454,028.76
交易性金融资产	-	-	-	611,759,436.71	611,759,436.71
资产总计	5,842,707.68	-	-	611,759,436.71	617,602,144.39
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	83,850.24	83,850.24
应付托管费	-	-	-	27,950.09	27,950.09

应付清算款	-	-	-	13,499.02	13,499.02
其他负债	-	-	-	172,492.20	172,492.20
负债总计	-	-	-	297,791.55	297,791.55
利率敏感度缺口	5,842,707.68	-	-	611,461,645.16	617,304,352.84

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 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、跟踪中证 A500 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中证 A500 指数，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资于中证 A500 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	457,878,591.69	98.68	611,759,436.71	99.10
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	457,878,591.69	98.68	611,759,436.71	99.10

6.4.13.4.3.2 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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末 （2025 年 12 月 31 日 ）
	业绩比较基准上升 5%	23,018,273.58	30,548,787.86
	业绩比较基准下降 5%	-23,018,273.58	-30,548,787.86

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	450,687,675.15	604,871,497.13
第二层次	2,235,584.00	3,928,727.92
第三层次	4,955,332.54	2,959,211.66
合计	457,878,591.69	611,759,436.71

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 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(上年度末：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	457,878,591.69	98.50
	其中：股票	457,878,591.69	98.50
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	6,913,491.02	1.49
8	其他各项资产	76,846.01	0.02
9	合计	464,868,928.72	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）。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,423,022.00	0.31
B	采矿业	18,635,792.60	4.02
C	制造业	320,238,316.29	69.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,873,500.00	2.13
E	建筑业	5,518,028.00	1.19
F	批发和零售业	3,641,281.00	0.78
G	交通运输、仓储和邮政业	10,077,882.32	2.17
H	住宿和餐饮业	213,801.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,300,871.11	5.45
J	金融业	43,807,574.63	9.44
K	房地产业	2,533,532.00	0.55
L	租赁和商务服务业	3,265,510.40	0.70
M	科学研究和技术服务业	5,412,665.00	1.17
N	水利、环境和公共设施管理业	775,669.52	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	151,740.00	0.03
Q	卫生和社会工作	889,874.28	0.19
R	文化、体育和娱	347,824.00	0.07

	乐业		
S	综合	818,216.00	0.18
	合计	452,925,100.15	97.61

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	36,149.82	0.01
C	制造业	4,917,599.26	1.06
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,583.46	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,955,332.54	1.07

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	15,200	19,304,000.00	4.16
2	300750	宁德时代	36,105	14,189,626.05	3.06
3	300502	新易盛	19,092	11,588,844.00	2.50
4	600519	贵州茅台	8,600	10,195,214.00	2.20
5	603986	兆易创新	9,200	7,498,000.00	1.62
6	601318	中国平安	145,700	6,955,718.00	1.50
7	688256	寒武纪	4,231	6,750,772.05	1.45
8	600036	招商银行	169,101	6,003,085.50	1.29
9	601899	紫金矿业	225,200	5,661,528.00	1.22
10	002371	北方华创	5,820	5,148,139.20	1.11
11	000333	美的集团	66,400	5,015,192.00	1.08
12	002475	立讯精密	69,668	4,904,627.20	1.06
13	688008	澜起科技	15,680	4,859,232.00	1.05
14	688012	中微公司	10,049	4,707,956.50	1.01
15	688041	海光信息	12,486	4,623,565.80	1.00
16	002384	东山精密	17,600	4,617,360.00	1.00
17	600900	长江电力	167,200	4,425,784.00	0.95
18	688981	中芯国际	27,474	4,363,420.68	0.94
19	000725	京东方 A	496,500	4,309,620.00	0.93
20	603259	药明康德	33,800	4,208,438.00	0.91
21	601166	兴业银行	231,400	3,831,984.00	0.83
22	600030	中信证券	132,100	3,795,233.00	0.82
23	300059	东方财富	172,900	3,523,702.00	0.76
24	600183	生益科技	19,900	3,450,660.00	0.74
25	600276	恒瑞医药	61,000	3,174,440.00	0.68
26	300274	阳光电源	19,900	3,164,498.00	0.68
27	601398	工商银行	441,900	3,124,233.00	0.67
28	300408	三环集团	18,400	3,070,960.00	0.66
29	600487	亨通光电	27,100	2,963,114.00	0.64
30	002594	比亚迪	37,000	2,948,900.00	0.64
31	300476	胜宏科技	8,400	2,910,012.00	0.63
32	002463	沪电股份	18,500	2,826,800.00	0.61
33	601211	国泰海通	154,300	2,808,260.00	0.61
34	300394	天孚通信	9,180	2,778,602.40	0.60
35	688498	源杰科技	1,400	2,640,400.00	0.57
36	688525	佰维存储	5,141	2,543,406.93	0.55
37	301308	江波龙	3,600	2,533,680.00	0.55
38	000988	华工科技	13,700	2,529,157.00	0.55
39	600176	中国巨石	32,800	2,390,464.00	0.52
40	601288	农业银行	388,900	2,360,623.00	0.51
41	601328	交通银行	364,425	2,343,252.75	0.51
42	000651	格力电器	61,300	2,298,750.00	0.50

43	600522	中天科技	37,200	2,257,296.00	0.49
44	688521	芯原股份	6,026	2,236,489.64	0.48
45	688072	拓荆科技	2,687	2,235,584.00	0.48
46	603019	中科曙光	20,000	2,144,600.00	0.46
47	300604	长川科技	6,200	2,116,804.00	0.46
48	603993	洛阳钼业	119,200	2,091,960.00	0.45
49	600150	中国船舶	61,703	2,084,944.37	0.45
50	600887	伊利股份	86,400	2,070,144.00	0.45
51	600584	长电科技	19,600	2,029,580.00	0.44
52	000338	潍柴动力	73,500	2,002,875.00	0.43
53	000858	五 粮 液	26,400	1,953,600.00	0.42
54	688347	华虹宏力	5,540	1,863,102.00	0.40
55	601816	京沪高铁	400,900	1,816,077.00	0.39
56	600309	万华化学	25,600	1,751,296.00	0.38
57	688120	华海清科	5,349	1,723,340.82	0.37
58	002281	光迅科技	6,700	1,721,498.00	0.37
59	002415	海康威视	50,100	1,713,420.00	0.37
60	300124	汇川技术	25,800	1,711,314.00	0.37
61	002008	大族激光	11,200	1,681,232.00	0.36
62	600111	北方稀土	34,500	1,657,725.00	0.36
63	002916	深南电路	3,610	1,653,019.00	0.36
64	000100	TCL 科技	281,500	1,638,330.00	0.35
65	300857	协创数据	4,800	1,631,520.00	0.35
66	000063	中兴通讯	44,000	1,592,360.00	0.34
67	300136	信维通信	13,200	1,574,100.00	0.34
68	600000	浦发银行	181,958	1,566,658.38	0.34
69	600089	特变电工	68,900	1,550,250.00	0.33
70	601857	中国石油	177,000	1,536,360.00	0.33
71	002028	思源电气	8,500	1,470,500.00	0.32
72	300433	蓝思科技	27,300	1,464,918.00	0.32
73	601088	中国神华	37,500	1,464,000.00	0.32
74	600031	三一重工	81,100	1,401,408.00	0.30
75	300475	香农芯创	4,600	1,380,000.00	0.30
76	300014	亿纬锂能	20,800	1,352,624.00	0.29
77	300223	北京君正	5,400	1,344,060.00	0.29
78	002050	三花智控	30,600	1,341,198.00	0.29
79	601601	中国太保	46,700	1,331,884.00	0.29
80	000001	平安银行	132,500	1,331,625.00	0.29
81	000792	盐湖股份	43,400	1,310,246.00	0.28
82	002714	牧原股份	37,200	1,301,628.00	0.28
83	600549	厦门钨业	15,100	1,286,520.00	0.28
84	002353	杰瑞股份	8,400	1,281,000.00	0.28
85	002156	通富微电	16,700	1,267,029.00	0.27

86	600406	国电南瑞	54,800	1,252,180.00	0.27
87	601668	中国建筑	282,200	1,224,748.00	0.26
88	000657	中钨高新	12,400	1,186,928.00	0.26
89	002436	兴森科技	23,200	1,182,040.00	0.25
90	002602	世纪华通	80,700	1,137,870.00	0.25
91	601919	中远海控	85,000	1,127,100.00	0.24
92	601988	中国银行	193,700	1,107,964.00	0.24
93	600660	福耀玻璃	21,900	1,104,636.00	0.24
94	300054	鼎龙股份	10,400	1,102,088.00	0.24
95	601728	中国电信	212,100	1,100,799.00	0.24
96	603501	豪威集团	11,600	1,100,260.00	0.24
97	300760	迈瑞医疗	8,100	1,100,223.00	0.24
98	601012	隆基绿能	82,876	1,087,333.12	0.23
99	601225	陕西煤业	53,000	1,078,550.00	0.23
100	600941	中国移动	12,500	1,076,625.00	0.23
101	002230	科大讯飞	26,200	1,070,008.00	0.23
102	600690	海尔智家	51,300	1,047,033.00	0.23
103	002352	顺丰控股	32,800	1,025,328.00	0.22
104	601985	中国核电	112,500	1,015,875.00	0.22
105	002709	天赐材料	19,600	1,008,028.00	0.22
106	688777	中控技术	8,530	1,002,275.00	0.22
107	002938	鹏鼎控股	9,500	1,001,110.00	0.22
108	002460	赣锋锂业	15,300	1,000,620.00	0.22
109	603799	华友钴业	20,700	998,982.00	0.22
110	300757	罗博特科	1,600	990,400.00	0.21
111	600160	巨化股份	18,500	980,685.00	0.21
112	000977	浪潮信息	14,000	980,000.00	0.21
113	300033	同花顺	4,020	968,820.00	0.21
114	002851	麦格米特	5,700	952,926.00	0.21
115	300442	润泽科技	11,200	930,384.00	0.20
116	000425	徐工机械	111,900	905,271.00	0.20
117	688126	沪硅产业	22,554	899,679.06	0.19
118	000938	紫光股份	31,000	894,660.00	0.19
119	002202	金风科技	37,400	893,860.00	0.19
120	601600	中国铝业	108,300	890,226.00	0.19
121	300567	精测电子	2,800	889,280.00	0.19
122	600028	中国石化	199,100	887,986.00	0.19
123	600938	中国海油	32,700	887,805.00	0.19
124	300346	南大光电	9,480	878,322.00	0.19
125	300661	圣邦股份	6,060	869,488.80	0.19
126	002466	天齐锂业	14,100	864,612.00	0.19
127	601766	中国中车	166,200	864,240.00	0.19
128	600460	士兰微	15,800	863,628.00	0.19

129	002600	领益智造	49,500	858,330.00	0.18
130	600050	中国联通	213,600	854,400.00	0.18
131	002049	紫光国微	9,360	830,700.00	0.18
132	002837	英维克	10,410	828,219.60	0.18
133	002080	中材科技	9,200	828,000.00	0.18
134	002407	多氟多	16,200	813,726.00	0.18
135	002185	华天科技	36,200	807,622.00	0.17
136	002138	顺络电子	11,000	804,100.00	0.17
137	002179	中航光电	17,400	803,880.00	0.17
138	601628	中国人寿	22,700	802,445.00	0.17
139	601100	恒立液压	7,400	795,944.00	0.17
140	000568	泸州老窖	10,100	782,952.00	0.17
141	688002	睿创微纳	5,027	777,626.63	0.17
142	300395	菲利华	5,800	775,634.00	0.17
143	601872	招商轮船	44,100	774,837.00	0.17
144	600879	航天电子	36,000	766,440.00	0.17
145	002241	歌尔股份	33,900	763,767.00	0.16
146	601006	大秦铁路	162,800	750,508.00	0.16
147	605117	德业股份	7,052	748,781.36	0.16
148	300390	天华新能	8,000	748,080.00	0.16
149	603288	海天味业	22,515	746,597.40	0.16
150	601658	邮储银行	150,600	742,458.00	0.16
151	000408	藏格矿业	10,700	741,724.00	0.16
152	688469	芯联集成	68,628	728,143.08	0.16
153	600905	三峡能源	195,200	724,192.00	0.16
154	600489	中金黄金	39,800	718,390.00	0.15
155	002625	光启技术	23,500	712,520.00	0.15
156	601888	中国中免	13,200	708,972.00	0.15
157	688017	绿的谐波	1,692	707,019.12	0.15
158	600893	航发动力	18,300	701,622.00	0.15
159	000630	铜陵有色	109,900	698,964.00	0.15
160	600673	东阳光	20,600	691,748.00	0.15
161	600010	包钢股份	309,000	689,070.00	0.15
162	688396	华润微	7,027	685,483.85	0.15
163	601127	赛力斯	11,100	679,875.00	0.15
164	300037	新宙邦	7,300	677,805.00	0.15
165	688271	联影医疗	6,689	677,127.47	0.15
166	300058	蓝色光标	49,140	676,166.40	0.15
167	002273	水晶光电	18,843	668,549.64	0.14
168	002027	分众传媒	138,100	668,404.00	0.14
169	601689	拓普集团	11,800	665,756.00	0.14
170	600118	中国卫星	8,100	664,605.00	0.14
171	600019	宝钢股份	119,000	646,170.00	0.14

172	688111	金山办公	3,014	642,132.70	0.14
173	000426	兴业银锡	19,400	639,424.00	0.14
174	600760	中航沈飞	15,400	632,940.00	0.14
175	000807	云铝股份	28,500	630,990.00	0.14
176	300751	迈为股份	2,200	621,412.00	0.13
177	601168	西部矿业	22,800	618,792.00	0.13
178	600104	上汽集团	62,800	612,928.00	0.13
179	600989	宝丰能源	30,100	611,933.00	0.13
180	300450	先导智能	14,900	606,728.00	0.13
181	600362	江西铜业	14,000	606,200.00	0.13
182	601727	上海电气	86,200	603,400.00	0.13
183	600875	东方电气	20,800	598,416.00	0.13
184	600988	赤峰黄金	22,700	597,464.00	0.13
185	002001	新 和 成	21,000	596,820.00	0.13
186	688099	晶晨股份	5,766	593,321.40	0.13
187	600885	宏发股份	17,020	587,019.80	0.13
188	605589	圣泉集团	9,200	584,844.00	0.13
189	600667	太极实业	20,000	583,600.00	0.13
190	601390	中国中铁	139,900	583,383.00	0.13
191	002422	科伦药业	15,100	581,652.00	0.13
192	002738	中矿资源	9,800	578,102.00	0.12
193	000538	云南白药	12,200	577,914.00	0.12
194	002126	银轮股份	11,600	577,680.00	0.12
195	600392	盛和资源	19,247	572,983.19	0.12
196	000960	锡业股份	13,400	572,046.00	0.12
197	600795	国电电力	121,800	568,806.00	0.12
198	600547	山东黄金	24,600	568,014.00	0.12
199	000831	中国稀土	10,200	565,998.00	0.12
200	600418	江淮汽车	21,600	557,928.00	0.12
201	600585	海螺水泥	32,800	555,960.00	0.12
202	601669	中国电建	117,700	553,190.00	0.12
203	300316	晶盛机电	9,000	543,600.00	0.12
204	002812	恩捷股份	8,100	541,971.00	0.12
205	002648	卫星化学	23,000	540,270.00	0.12
206	600141	兴发集团	11,400	535,458.00	0.12
207	600096	云天化	17,500	532,000.00	0.11
208	301358	湖南裕能	7,000	531,090.00	0.11
209	002129	TCL 中环	44,125	530,382.50	0.11
210	300015	爱尔眼科	63,700	526,162.00	0.11
211	300782	卓胜微	4,776	523,354.08	0.11
212	601179	中国西电	35,000	522,200.00	0.11
213	600346	恒力石化	28,900	511,819.00	0.11
214	601868	中国能建	191,200	510,504.00	0.11

215	002195	岩山科技	77,400	506,196.00	0.11
216	600482	中国动力	15,400	505,120.00	0.11
217	002558	巨人网络	18,200	501,592.00	0.11
218	000066	中国长城	26,300	501,015.00	0.11
219	300418	昆仑万维	12,300	496,428.00	0.11
220	600497	驰宏锌锗	40,900	495,299.00	0.11
221	600580	卧龙电驱	14,900	493,190.00	0.11
222	600066	宇通客车	18,200	487,942.00	0.11
223	600426	华鲁恒升	20,300	485,576.00	0.10
224	000625	长安汽车	67,700	485,409.00	0.10
225	600157	永泰能源	298,100	479,941.00	0.10
226	002532	天山铝业	44,200	474,266.00	0.10
227	600895	张江高科	12,700	473,075.00	0.10
228	000157	中联重科	67,800	472,566.00	0.10
229	600221	海航控股	347,900	469,665.00	0.10
230	300803	指南针	5,100	467,517.00	0.10
231	600711	盛屯矿业	42,200	462,934.00	0.10
232	002340	格林美	69,700	460,717.00	0.10
233	600011	华能国际	60,200	456,918.00	0.10
234	000933	神火股份	21,500	455,800.00	0.10
235	688036	传音控股	7,717	454,917.15	0.10
236	600048	保利发展	98,100	454,203.00	0.10
237	600143	金发科技	29,300	452,685.00	0.10
238	600438	通威股份	36,800	445,648.00	0.10
239	300017	网宿科技	34,100	443,641.00	0.10
240	600115	中国东航	116,300	443,103.00	0.10
241	002236	大华股份	26,800	441,932.00	0.10
242	605499	东鹏饮料	3,580	441,879.40	0.10
243	002493	荣盛石化	41,000	440,750.00	0.09
244	002131	利欧股份	92,600	439,850.00	0.09
245	600570	恒生电子	20,700	438,633.00	0.09
246	002821	凯莱英	2,700	437,400.00	0.09
247	600436	片仔癀	4,000	437,120.00	0.09
248	600886	国投电力	32,800	436,568.00	0.09
249	002456	欧菲光	45,800	433,268.00	0.09
250	600352	浙江龙盛	35,500	429,905.00	0.09
251	688047	龙芯中科	2,755	426,115.85	0.09
252	601233	桐昆股份	19,500	422,175.00	0.09
253	003816	中国广核	107,500	420,325.00	0.09
254	300339	润和软件	10,900	419,759.00	0.09
255	603659	璞泰来	14,500	419,485.00	0.09
256	601360	三六零	47,700	414,513.00	0.09
257	601058	赛轮轮胎	35,900	413,927.00	0.09

258	000301	东方盛虹	36,100	413,345.00	0.09
259	600026	中远海能	22,800	409,032.00	0.09
260	300759	康龙化成	14,100	407,913.00	0.09
261	300438	鹏辉能源	4,900	405,965.00	0.09
262	002074	国轩高科	14,700	404,397.00	0.09
263	688213	思特威	3,746	401,084.22	0.09
264	002555	三七互娱	21,200	400,044.00	0.09
265	600009	上海机场	17,100	395,010.00	0.09
266	688578	艾力斯	3,580	390,936.00	0.08
267	000768	中航西飞	19,000	389,120.00	0.08
268	600196	复星医药	17,300	388,731.00	0.08
269	000975	山金国际	22,700	385,900.00	0.08
270	601111	中国国航	63,700	385,385.00	0.08
271	300207	欣旺达	20,200	383,598.00	0.08
272	688122	西部超导	6,103	383,329.43	0.08
273	300001	特锐德	10,100	382,083.00	0.08
274	002472	双环传动	9,200	381,892.00	0.08
275	600029	南方航空	73,700	381,766.00	0.08
276	600415	小商品城	37,500	381,000.00	0.08
277	688235	百济神州	1,496	380,896.56	0.08
278	002517	恺英网络	23,300	378,625.00	0.08
279	600219	南山铝业	94,200	375,858.00	0.08
280	002601	龙佰集团	22,800	375,744.00	0.08
281	600674	川投能源	26,500	375,505.00	0.08
282	300458	全志科技	9,500	374,870.00	0.08
283	002128	电投能源	16,200	374,544.00	0.08
284	601186	中国铁建	62,900	374,255.00	0.08
285	002595	豪迈科技	7,950	370,470.00	0.08
286	601117	中国化学	50,100	368,235.00	0.08
287	600233	圆通速递	23,300	366,975.00	0.08
288	601877	正泰电器	14,600	366,022.00	0.08
289	301236	软通动力	8,500	360,825.00	0.08
290	300115	长盈精密	12,900	360,426.00	0.08
291	603129	春风动力	1,400	358,120.00	0.08
292	600372	中航机载	33,000	358,050.00	0.08
293	300454	深信服	3,700	355,940.00	0.08
294	002155	湖南黄金	14,880	355,185.60	0.08
295	600839	四川长虹	50,554	352,866.92	0.08
296	688676	金盘科技	4,148	351,086.72	0.08
297	002465	海格通信	27,200	347,344.00	0.07
298	300972	万辰集团	2,000	346,820.00	0.07
299	300568	星源材质	18,400	344,448.00	0.07
300	002920	德赛西威	4,200	342,300.00	0.07

301	300347	泰格医药	7,100	340,800.00	0.07
302	000963	华东医药	12,000	337,440.00	0.07
303	000547	航天发展	17,500	335,125.00	0.07
304	600741	华域汽车	21,500	333,680.00	0.07
305	300024	机器人	17,200	332,476.00	0.07
306	002130	沃尔核材	17,300	328,008.00	0.07
307	002432	九安医疗	4,600	325,128.00	0.07
308	603650	彤程新材	3,300	323,334.00	0.07
309	300496	中科创达	5,200	321,308.00	0.07
310	002497	雅化集团	15,700	319,809.00	0.07
311	300012	华测检测	23,000	318,780.00	0.07
312	001979	招商蛇口	49,300	316,999.00	0.07
313	000878	云南铜业	19,900	316,012.00	0.07
314	601021	春秋航空	6,804	310,126.32	0.07
315	300083	创世纪	22,700	309,174.00	0.07
316	000034	神州数码	11,140	309,135.00	0.07
317	002414	高德红外	23,300	308,958.00	0.07
318	002271	东方雨虹	26,000	308,620.00	0.07
319	300474	景嘉微	5,100	308,448.00	0.07
320	300763	锦浪科技	3,400	307,190.00	0.07
321	603979	金诚信	5,200	306,956.00	0.07
322	000661	长春高新	4,600	306,360.00	0.07
323	000733	振华科技	5,400	305,856.00	0.07
324	002444	巨星科技	9,800	304,780.00	0.07
325	688331	荣昌生物	2,331	303,636.06	0.07
326	300866	安克创新	2,900	303,050.00	0.07
327	002756	永兴材料	5,300	300,192.00	0.06
328	688506	百利天恒	1,017	299,028.51	0.06
329	002025	航天电器	3,900	297,258.00	0.06
330	688266	泽璟制药	2,531	295,266.46	0.06
331	601319	中国人保	43,600	294,736.00	0.06
332	300748	金力永磁	9,400	289,990.00	0.06
333	300073	当升科技	6,000	288,240.00	0.06
334	600699	均胜电子	13,300	287,413.00	0.06
335	002078	太阳纸业	22,900	286,021.00	0.06
336	601615	明阳智能	24,700	285,779.00	0.06
337	300919	中伟新材	6,500	284,375.00	0.06
338	603606	东方电缆	6,840	283,928.40	0.06
339	601677	明泰铝业	17,100	283,860.00	0.06
340	603087	甘李药业	5,000	283,800.00	0.06
341	300142	沃森生物	21,800	283,182.00	0.06
342	300432	富临精工	14,000	281,260.00	0.06
343	000423	东阿阿胶	6,200	281,232.00	0.06

344	600039	四川路桥	35,600	278,392.00	0.06
345	601800	中国交建	48,700	278,077.00	0.06
346	000002	万　科 A	93,100	275,576.00	0.06
347	300724	捷佳伟创	3,900	275,340.00	0.06
348	002252	上海莱士	63,100	273,854.00	0.06
349	600226	亨通股份	28,500	273,315.00	0.06
350	688599	天合光能	19,318	272,770.16	0.06
351	688169	石头科技	2,855	271,139.35	0.06
352	688223	晶科能源	55,992	265,962.00	0.06
353	002064	华峰化学	27,200	258,128.00	0.06
354	601633	长城汽车	17,100	258,039.00	0.06
355	600588	用友网络	28,100	257,958.00	0.06
356	688608	恒玄科技	1,541	257,639.79	0.06
357	001965	招商公路	27,900	255,564.00	0.06
358	002831	裕同科技	7,100	252,476.00	0.05
359	000786	北新建材	13,900	251,451.00	0.05
360	688065	凯赛生物	5,235	250,494.75	0.05
361	688390	固德威	2,307	250,332.57	0.05
362	300677	英科医疗	6,300	246,771.00	0.05
363	002294	信立泰	7,700	245,553.00	0.05
364	688180	君实生物	7,108	240,392.56	0.05
365	000519	中兵红箭	11,400	240,198.00	0.05
366	302132	中航成飞	4,100	239,112.00	0.05
367	603806	福斯特	14,200	238,418.00	0.05
368	600516	方大炭素	38,600	238,162.00	0.05
369	601618	中国中冶	97,500	237,900.00	0.05
370	603260	合盛硅业	4,900	236,474.00	0.05
371	601607	上海医药	15,200	234,080.00	0.05
372	002176	江特电机	23,300	233,233.00	0.05
373	600177	雅戈尔	30,700	231,171.00	0.05
374	300832	新产业	5,500	231,000.00	0.05
375	000623	吉林敖东	13,000	230,490.00	0.05
376	300699	光威复材	8,000	229,200.00	0.05
377	000617	中油资本	34,500	227,355.00	0.05
378	300342	天银机电	4,800	225,600.00	0.05
379	002085	万丰奥威	20,300	225,127.00	0.05
380	002318	久立特材	9,400	224,660.00	0.05
381	688188	柏楚电子	2,103	224,390.10	0.05
382	300251	光线传媒	20,100	222,909.00	0.05
383	300558	贝达药业	3,400	221,238.00	0.05
384	002459	晶澳科技	27,200	220,320.00	0.05
385	301550	斯菱智驱	2,400	219,432.00	0.05
386	605090	九丰能源	5,900	219,303.00	0.05

387	002065	东华软件	30,700	219,198.00	0.05
388	600085	同仁堂	9,400	217,234.00	0.05
389	002266	浙富控股	42,800	216,568.00	0.05
390	688472	阿特斯	19,946	215,815.72	0.05
391	002044	美年健康	42,800	215,284.00	0.05
392	600499	科达制造	15,600	215,280.00	0.05
393	603596	伯特利	8,644	214,716.96	0.05
394	600515	海南机场	78,000	213,720.00	0.05
395	300409	道氏技术	10,700	213,251.00	0.05
396	002223	鱼跃医疗	8,300	212,978.00	0.05
397	000400	许继电气	9,800	212,660.00	0.05
398	300003	乐普医疗	17,700	209,745.00	0.05
399	002405	四维图新	32,400	209,628.00	0.05
400	688005	容百科技	6,775	207,315.00	0.04
401	000032	深桑达 A	8,300	207,085.00	0.04
402	000415	渤海租赁	50,700	206,349.00	0.04
403	000999	华润三九	9,140	205,558.60	0.04
404	600862	中航高科	11,400	205,542.00	0.04
405	000683	博源化工	35,500	204,480.00	0.04
405	600521	华海药业	14,200	204,480.00	0.04
407	000039	中集集团	25,100	203,561.00	0.04
408	688114	华大智造	3,978	203,196.24	0.04
409	603766	隆鑫通用	16,900	201,617.00	0.04
410	600803	新奥股份	12,700	200,660.00	0.04
411	600704	物产中大	42,400	200,128.00	0.04
412	601216	君正集团	44,800	199,808.00	0.04
413	600312	平高电气	11,100	196,026.00	0.04
414	600018	上港集团	41,400	195,408.00	0.04
415	000887	中鼎股份	10,800	193,212.00	0.04
416	600332	白云山	9,600	192,384.00	0.04
417	603605	珀莱雅	3,200	191,744.00	0.04
418	300122	智飞生物	16,400	191,716.00	0.04
419	000967	盈峰环境	18,200	191,646.00	0.04
420	600765	中航重机	14,800	191,216.00	0.04
421	688617	惠泰医疗	1,047	190,093.32	0.04
422	600166	福田汽车	64,900	188,859.00	0.04
423	688116	天奈科技	4,914	187,714.80	0.04
424	000830	鲁西化工	15,500	186,000.00	0.04
425	600153	建发股份	23,300	184,769.00	0.04
426	002410	广联达	22,500	183,600.00	0.04
427	002007	华兰生物	14,900	181,631.00	0.04
428	600323	瀚蓝环境	6,600	181,236.00	0.04
429	300896	爱美客	1,980	172,656.00	0.04

430	603568	伟明环保	11,220	172,563.60	0.04
431	601799	星宇股份	1,900	172,178.00	0.04
432	002603	以岭药业	11,400	171,000.00	0.04
433	600398	海澜之家	32,500	169,975.00	0.04
434	601000	唐山港	40,500	168,075.00	0.04
435	600529	山东药玻	9,100	167,895.00	0.04
436	600316	洪都航空	6,000	167,640.00	0.04
437	601018	宁波港	53,200	167,580.00	0.04
438	600486	扬农化工	3,300	167,310.00	0.04
439	002389	航天彩虹	9,400	167,038.00	0.04
440	000738	航发控制	9,000	164,610.00	0.04
441	600208	衢州发展	58,000	164,140.00	0.04
442	688009	中国通号	34,423	163,853.48	0.04
443	600008	首创环保	60,200	163,744.00	0.04
444	000932	华菱钢铁	46,700	162,049.00	0.03
445	600170	上海建工	72,900	161,838.00	0.03
446	600998	九州通	34,400	161,336.00	0.03
447	603486	科沃斯	3,100	157,325.00	0.03
448	600820	隧道股份	30,100	156,821.00	0.03
449	600161	天坛生物	13,500	156,330.00	0.03
450	300118	东方日升	12,400	154,380.00	0.03
451	601238	广汽集团	30,000	152,400.00	0.03
452	603885	吉祥航空	14,800	152,292.00	0.03
453	603816	顾家家居	6,800	152,048.00	0.03
454	002607	中公教育	84,300	151,740.00	0.03
455	688303	大全能源	8,686	151,396.98	0.03
456	688166	博瑞医药	4,290	150,192.90	0.03
457	603939	益丰药房	8,300	149,234.00	0.03
458	600763	通策医疗	4,381	148,428.28	0.03
459	600038	中直股份	5,700	144,153.00	0.03
460	300049	福瑞医科	3,700	143,856.00	0.03
461	601567	三星电气	9,600	143,424.00	0.03
462	603392	万泰生物	5,300	142,941.00	0.03
463	601880	辽港股份	100,500	138,690.00	0.03
464	600511	国药股份	5,300	138,012.00	0.03
465	300573	兴齐眼药	3,361	136,994.36	0.03
466	300676	华大基因	3,900	136,734.00	0.03
467	600535	天士力	10,200	134,946.00	0.03
468	300100	双林股份	4,800	133,344.00	0.03
469	600816	建元信托	53,800	131,272.00	0.03
470	002244	滨江集团	17,100	129,960.00	0.03
471	000833	粤桂股份	5,400	126,468.00	0.03
472	601155	新城控股	12,300	126,198.00	0.03

473	002120	韵达股份	19,800	125,928.00	0.03
474	300144	宋城演艺	21,500	124,915.00	0.03
475	688063	派能科技	2,332	124,225.64	0.03
476	000998	隆平高科	16,100	121,394.00	0.03
477	002544	普天科技	6,600	120,252.00	0.03
478	600064	南京高科	16,600	118,358.00	0.03
479	601866	中远海发	53,300	117,793.00	0.03
480	300457	赢合科技	5,400	113,832.00	0.02
481	600754	锦江酒店	6,300	113,337.00	0.02
482	600635	大众公用	26,300	112,564.00	0.02
483	000035	中国天楹	22,824	110,239.92	0.02
484	600655	豫园股份	26,500	108,915.00	0.02
485	603899	晨光股份	5,100	105,213.00	0.02
486	300601	康泰生物	9,200	104,328.00	0.02
487	600663	陆家嘴	16,200	101,736.00	0.02
488	600004	白云机场	14,000	101,640.00	0.02
489	600258	首旅酒店	9,200	100,464.00	0.02
490	600859	王府井	10,700	98,226.00	0.02
491	002091	江苏国泰	13,300	96,159.00	0.02
492	300070	碧水源	29,800	95,062.00	0.02
493	000069	华侨城 A	54,900	90,036.00	0.02
494	600864	哈投股份	17,100	88,749.00	0.02
495	301078	孩子王	12,100	81,796.00	0.02
496	002292	奥飞娱乐	12,100	79,376.00	0.02
497	603833	欧派家居	2,500	75,275.00	0.02
498	002891	中宠股份	2,800	74,816.00	0.02
499	600325	华发股份	30,100	69,531.00	0.01
500	002572	索菲亚	7,900	57,670.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688795	摩尔线程	2,560	1,732,966.40	0.37
2	688802	沐曦股份	1,764	1,356,321.96	0.29
3	688759	必贝特	12,552	384,718.80	0.08
4	301666	大普微	706	327,110.98	0.07
5	688790	昂瑞微	1,913	241,898.85	0.05
6	688808	联讯仪器	107	169,523.31	0.04
7	688818	电科蓝天	1,693	118,747.02	0.03
8	688820	盛合晶微	659	93,241.91	0.02
9	688797	臻宝科技	154	72,175.18	0.02
10	001399	惠科股份	2,083	57,761.59	0.01
11	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.01

12	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.01
13	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.01
14	688635	长进光子	128	39,448.32	0.01
15	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.01
16	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
17	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
18	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
19	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
20	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
21	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
22	001365	天海电子	396	12,398.76	0.00
23	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
24	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
25	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
26	001237	惠康科技	163	9,574.62	0.00
27	601112	振石股份	533	9,375.47	0.00
28	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
29	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
30	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
31	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
32	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
33	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
34	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	7,839,830.00	1.27
2	300308	中际旭创	6,174,977.00	1.00
3	300394	天孚通信	4,442,758.77	0.72
4	300502	新易盛	4,164,334.07	0.67
5	000333	美的集团	3,354,874.84	0.54
6	002475	立讯精密	3,089,096.00	0.50
7	002594	比亚迪	2,822,596.00	0.46
8	002384	东山精密	2,639,617.00	0.43
9	300476	胜宏科技	2,635,291.00	0.43
10	300972	万辰集团	2,455,482.00	0.40
11	688521	芯原股份	2,401,523.71	0.39
12	600519	贵州茅台	2,298,739.00	0.37
13	301308	江波龙	2,285,974.00	0.37
14	300274	阳光电源	2,241,671.00	0.36
15	300059	东方财富	2,192,478.00	0.36
16	000858	五 粮 液	2,144,171.00	0.35

17	688498	源杰科技	2,007,255.59	0.33
18	300567	精测电子	1,958,118.00	0.32
19	300604	长川科技	1,748,315.00	0.28
20	688525	佰维存储	1,619,150.70	0.26

注：买入金额不包括相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	16,000,359.40	2.59
2	300308	中际旭创	11,517,474.00	1.87
3	300502	新易盛	7,503,207.00	1.22
4	000333	美的集团	6,351,080.80	1.03
5	300394	天孚通信	5,363,005.00	0.87
6	002475	立讯精密	4,951,824.00	0.80
7	002594	比亚迪	4,747,541.00	0.77
8	300059	东方财富	4,192,118.81	0.68
9	300476	胜宏科技	3,775,914.00	0.61
10	300274	阳光电源	3,701,027.00	0.60
11	000858	五 粮 液	3,648,256.00	0.59
12	002384	东山精密	3,436,830.00	0.56
13	688256	寒武纪	2,883,996.53	0.47
14	000651	格力电器	2,805,554.50	0.45
15	000725	京东方 A	2,718,044.00	0.44
16	688041	海光信息	2,650,406.77	0.43
17	300972	万辰集团	2,570,010.00	0.42
18	002028	思源电气	2,558,328.00	0.41
19	000338	潍柴动力	2,383,208.00	0.39
20	002463	沪电股份	2,290,376.00	0.37

注：卖出金额不包括相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	194,459,311.99
卖出股票收入（成交）总额	293,926,506.04

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

7.5 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。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

华宝中证 A500ETF 截止 2026 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,招商银行股份有限公司因内部制度不完善；于 2025 年 09 月 12 日收到金融监管总局警告,罚款的处罚措施。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和分析，认为上述处分不会对公司的投资价值构成实质性影响，因此本基金管理人对上述证券的投资判断未发生改变。报告期内，本基金投资的前十名证券的其余的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	16,353.38
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	60,492.63
8	其他	-
9	合计	76,846.01

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	688795	摩尔线程	1,732,966.40	0.37	新股锁定
2	688802	沐曦股份	1,356,321.96	0.29	新股锁定
3	688759	必贝特	384,718.80	0.08	新股锁定
4	301666	大普微	327,110.98	0.07	新股锁定
5	688790	昂瑞微	241,898.85	0.05	新股锁定

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，合计数可能不等于分项之和。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.1.1 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（%）
1,231	534,491.24	596,278,506.00	90.63	61,680,206.00	9.37

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例（%）
兴业银行股份有限公司 - 华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	329,080,200.00	50.02

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.0000

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2024 年 11 月 22 日）基金份额总额	1,999,979,356.00
本报告期期初基金份额总额	993,958,712.00
本报告期基金总申购份额	390,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	726,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	657,958,712.00

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

报告期内托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产和基金托管业务的诉讼事项。

10.4 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。

10.5 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向本基金提供的审计服务持续期限为：2025 年 11 月 11 日起至本报告期末。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人相关从业人员在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
国泰海通	5	486,719,043.34	100.00	90,484.74	100.00	-

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:资力雄厚，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.本期交易单元未发生变化。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期内未使用证券公司交易单元进行其他证券投资。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2026-01-22
2	华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金第四次分红公告	基金管理人网站,中国证券报	2026-02-11
3	华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年年度报告	基金管理人网站	2026-03-31
4	华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2026-04-22
5	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国海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	2026-04-28
6	华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金第五次分红公告	基金管理人网站,中国证券报	2026-05-15
7	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华源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	2026-05-20
8	华宝基金关于旗下部分基金新增上海国信嘉利基金销售有限公司为代销机构的公告	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	2026-06-10

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
兴业银行股份有限公司-华宝中证A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	20260101~20260630	419,399,500.00	28,225,000.00	118,544,300.00	329,080,200.00	50.02
产品特有风险							
报告期内本基金出现单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况。 在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下，如该投资者集中赎回，可能会增加基金的流动性风险。此外，由于基金在遇到大额赎回的时候可能需要变现部分资产，可能对持有资产的价格形成冲击，增加基金的市场风险。基金管理人将专业审慎、勤勉尽责地运作基金资产，加强防范流动性风险、市场风险，保护持有人利益。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；

华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同；

华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书；

华宝中证 A500 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。

12.2 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。

12.3 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 8 月 31 日