

华宝创业板综合增强策略交易型开放式指 数证券投资基金 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合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
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合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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	16
§ 7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	34
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	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
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	43
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	43
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	43

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	43
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	43
7.12 投资组合报告附注	43
§ 8 基金份额持有人信息	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	44
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	45
§ 9 开放式基金份额变动	45
§ 10 重大事件揭示	45
10.1 基金份额持有人大会决议	45
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	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	45
10.4 基金投资策略的改变	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	45
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	45
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	46
10.8 其他重大事件	47
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	47
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	47
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	48
§ 12 备查文件目录	48
12.1 备查文件目录	48
12.2 存放地点	48
12.3 查阅方式	48

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华宝创业板综合增强策略 ETF
场内简称	创业板综增强 ETF 华宝
基金主代码	159292
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 8 月 20 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	187,189,531.00 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	2025 年 9 月 2 日

2.2 基金产品说明

投资目标	通过数量化的投资策略模型精选创业板优质股票，在对标的指数进行有效跟踪的基础上，力争获得超越业绩比较基准的超额收益。控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 6.5%。
投资策略	本基金主要投资于创业板综合指数成份股及备选成份股。本基金股票投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于标的指数成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。大类资产配置不作为本基金的核心策略。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出合适调整。
业绩比较基准	创业板综合指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 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	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦

	58 楼	
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	9,180,726.16
本期利润	12,598,636.79
加权平均基金份额本期利润	0.2712
本期加权平均净值利润率	22.19%
本期基金份额净值增长率	23.18%
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	64,448,418.90
期末可供分配基金份额利润	0.3443
期末基金资产净值	253,328,832.04
期末基金份额净值	1.3533
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	35.33%

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

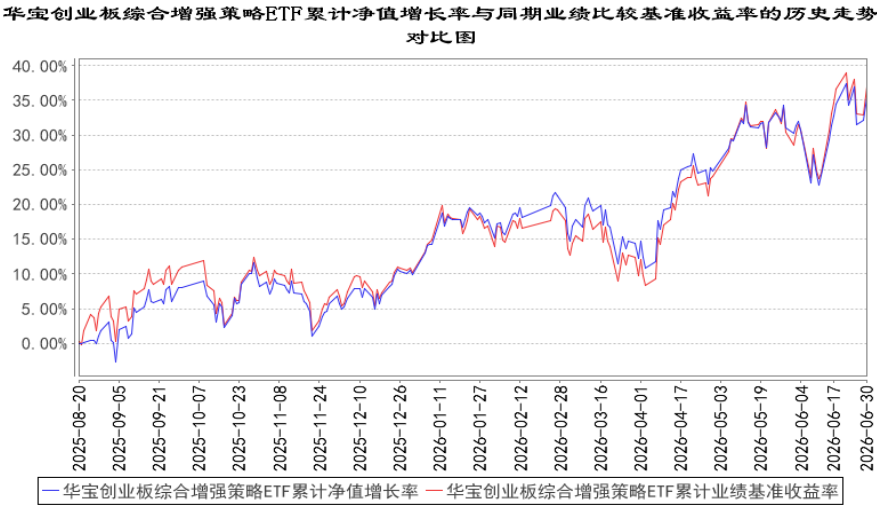
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	20.54%	1.86%	24.75%	1.95%	-4.21%	-0.09%
过去六个月	23.18%	1.68%	24.15%	1.79%	-0.97%	-0.11%
过去一年	-	-	-	-	-	-
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	35.33%	1.56%	36.87%	1.70%	-1.54%	-0.14%

注：（1）基金业绩基准：创业板综合指数收益率；

（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 2026 年 02 月 20 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		
王正	本基金经理	2025-08-20	-	14 年	硕士。2012 年 7 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任助理量化分析师、分析师、基金经理助理等职务。2020 年 1 月至 2026 年 1 月任华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理，2020 年 1 月起任华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金基金经理，2021 年 1 月至 2022 年 7 月任华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理，2021 年 1 月至 2024 年 7 月任华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 1 月至 2022 年 8 月任华宝智慧产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 6 月至 2023 年 3 月任华宝安盈混合型证券投资基金基金经理，2025 年 8 月起任华宝创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 8 月起任华宝中证稀有金属主题指数增强型发起式证券投资基金、华宝科技先锋混合型证券投资基金基金经理，2025 年 12 月起任华宝沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2026 年 1 月起任华宝沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资

					基金发起式联接基金基金经理，2026 年 6 月起任华宝创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（原：华宝创业板综指增强型发起式证券投资基金）基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

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

4.1.3 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、《华宝创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》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 年上半年，全球宏观呈现地缘冲突持续、货币政策预期扰动、资产走势分化的特征。一季度中东局势升级引发霍尔木兹海峡航运受阻，国际油价暴涨推升全球通胀粘性，美联储降息预期全面后移，全球金融条件骤然趋紧。二季度美伊关系出现和解迹象，原油快速回落。全球经济一季度受地缘冲击明显放缓，二季度在 AI 产业景气支撑下边际修复。大类资产走势分化，黄金丧失避险属性大幅回撤，美元指数在弱美元叙事与强现实之间反复博弈，美股韩股在 AI 产业周期推动下持续走强，市场波动率整体维持高位。国内经济展现总量稳健、结构分化、政策精准的运行特征，出口与生产端保持较强韧性，AI 相关产业成为主要增量来源，内需消费与投资偏弱。物价走势分化，PPI 受输入性因素影响有所冲高，CPI 则保持温和运行。整体看，中国经济在全球不确定性中凸显韧性，政策发力与产业升级为市场提供长期支撑。

股票市场方面，上半年，A 股呈现一季度防御避险、二季度科技突围的鲜明两段式行情，整体波动加剧、风格极致分化。报告期内本基金跟踪的创业板综合指数累计上涨 24.15%，中证红利下跌 8.75%，科创 50 上涨 64.25%，创业板指上涨 35.58%，中证 2000 指数上涨 9.10%。行业层面，电子、通信涨幅居前，而周期及消费板块普遍承压，部分行业已回落至 924 前水平。上半年整体来看，A 股完成从红利防御到科技进攻的剧烈风格切换，结构性机会高度集中于 AI 产业链，传统顺周期板块持续承压，资金抱团效应及拥挤度指标达到历史极端水平。因子层面，行业中性视角下，上半年市场风格极端分化，成长、动量、超预期、大市值等因子较为强势，价值、红利、低波等走势偏弱，市场短期呈现高估值、高波动、高换手占优的异常格局，二季度 Alpha 环境不太友好。

本基金运用量化 Alpha 多因子选股模型和风险模型进行股票筛选和权重配置，在创业板上市公司内精选业绩和估值相匹配、基本面优质的股票，并严格控制市值、行业等风险暴露，在有限的跟踪误差下力争实现稳定的超越指数的表现。

4.4.2 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 23.18%，业绩比较基准收益率为 24.15%。

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 年下半年，国际局势仍较为复杂，发达经济体增长放缓，下行风险仍存，贸易保护主义与地缘政治不确定性仍是主要威胁，但预计相比上半年的冲击反转和分化，下半年将进入风险与机会并存的格局。国内预计 GDP 增速保持稳定，政策重点从上半年的稳增长向促改革、扩内需深化，消费提振与房地产企稳仍是关键抓手，在托底经济的同时持续培育新质生产力、推动产

业结构转型升级。

从股票市场来看，上半年极致分化的市场环境在历史上极少持续超过 2 个季度，下半年市场风格有望迎来再平衡。经过二季度的科技抱团行情，AI 产业链部分标的估值已处于历史高位，资金拥挤度突破警戒阈值，短期波动风险加大；而周期、消费、红利等上半年持续承压的板块，估值已回落至历史低位，性价比优势逐步显现。随着基本面预期的修复和资金面的再配置，市场风格预计从高估值、高波动、高换手的极端状态向更加均衡的方向回归，成长与价值、大盘与小盘、科技与传统之间的剪刀差有望收敛。整体流动性仍较为充裕，投资者情绪在政策持续呵护下有望维持平稳，监管层引导上市公司提升质量、推动中长期资金入市等举措对市场长期健康发展起到积极作用。目前市场整体估值处于历史中等水平，未到泡沫区间，同时叠加基本面的持续改善与政策红利的逐步释放，A 股的长期战略配置价值仍然较高。从长周期来看，在不确定的环境下，估值有安全边际、经营稳健、基本面优质、有核心竞争力的公司仍有较高的配置价值，有望取得长期稳定的相对收益。基金将继续关注符合常识和逻辑的因子，不断打磨选股模型，在组合优化上注重行业和个股的分散、风格的均衡以及风险的控制，实现相对基准的稳健增强。

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

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金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：华宝创业板综合增强策略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	200,010.37	200,024.12
结算备付金		1,159,880.74	321,475.72
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	252,000,970.38	70,098,039.99
其中：股票投资		251,982,816.32	70,098,039.99

基金投资		-	-
债券投资		18,154.06	-
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		-	-
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		253,421,354.12	70,619,539.83
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		31,086.46	33,937.64
应付托管费		6,217.30	6,787.53
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.75	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	55,217.57	60,000.00
负债合计		92,522.08	100,725.17
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	187,189,531.00	64,189,531.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	66,139,301.04	6,329,283.66
净资产合计		253,328,832.04	70,518,814.66
负债和净资产总计		253,421,354.12	70,619,539.83

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.3533 元，基金份额总额 187,189,531.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华宝创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		12,882,282.58
1. 利息收入		237.67
其中：存款利息收入	6.4.7.9	237.67
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）		9,449,591.28
其中：股票投资收益	6.4.7.10	9,116,660.46
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	6,275.57
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	326,655.25
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	3,417,910.63
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	14,543.00
减：二、营业总支出		283,645.79
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	142,373.47
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	28,474.70
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		0. 08
8. 其他费用	6. 4. 7. 19	112, 797. 54
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		12, 598, 636. 79
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		12, 598, 636. 79
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		12, 598, 636. 79

注：本产品成立于 2025 年 08 月 20 日，故无上年度可比期间。

6.3 净资产变动表

会计主体：华宝创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金

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	64, 189, 531. 00	-	6, 329, 283. 66	70, 518, 814. 66
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	64, 189, 531. 00	-	6, 329, 283. 66	70, 518, 814. 66
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	123, 000, 000. 00	-	59, 810, 017. 38	182, 810, 017. 38
（一）、综合收益总额	-	-	12, 598, 636. 79	12, 598, 636. 79
（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）	123, 000, 000. 00	-	47, 211, 380. 59	170, 211, 380. 59
其中：1. 基金申购款	177, 000, 000. 00	-	59, 107, 400. 38	236, 107, 400. 38
2. 基金赎回款	-54, 000, 000. 00	-	-11, 896, 019. 79	-65, 896, 019. 79

（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	187,189,531.00	-	66,139,301.04	253,328,832.04

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：

<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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华宝创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2025]1580 号《关于准予华宝创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》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《华宝创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 514,165,000.00 元，业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2025)验字第 70072895_B10 号验资报告予以验证，经向中国证监会备案，《华宝创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2025 年 8 月 20 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 514,189,531.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 24,531.00 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《华宝创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及备选成份股、其他国内依法发行或上市的股票、存托凭证、衍生工具（股指期货、股票期权等）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等）、资

产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。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。

本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%；股指期货、股票期权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，即创业板综合指数收益率。

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 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	200,010.37
等于：本金	200,000.00
加：应计利息	10.37
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	200,010.37

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		246,368,306.92	-	251,982,816.32	5,614,509.40
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	14,200.00	1.05	18,154.06	3,953.01
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	14,200.00	1.05	18,154.06	3,953.01

资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	246,382,506.92	1.05	252,000,970.38	5,618,462.41

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	53,160.17
其他	2,057.40
合计	55,217.57

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	64,189,531.00	64,189,531.00
本期申购	177,000,000.00	177,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-54,000,000.00	-54,000,000.00
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	187,189,531.00	187,189,531.00

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	8,915,812.84	-2,586,529.18	6,329,283.66
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	8,915,812.84	-2,586,529.18	6,329,283.66
本期利润	9,180,726.16	3,417,910.63	12,598,636.79
本期基金份额交易产生的变动数	46,351,879.90	859,500.69	47,211,380.59
其中：基金申购款	59,228,647.74	-121,247.36	59,107,400.38
基金赎回款	-12,876,767.84	980,748.05	-11,896,019.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	64,448,418.90	1,690,882.14	66,139,301.04

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	181.93
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	55.74
其他	-
合计	237.67

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	4,761,313.69
股票投资收益——赎回差价收入	4,355,346.77
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	9,116,660.46

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	131,267,715.73
减：卖出股票成本总额	126,375,066.83
减：交易费用	131,335.21
买卖股票差价收入	4,761,313.69

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	65,896,019.79
减：现金支付赎回款总额	34,981.79
减：赎回股票成本总额	61,505,691.23
减：交易费用	—
赎回差价收入	4,355,346.77

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	2.12
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	6,273.45
债券投资收益——赎回差价收入	—
债券投资收益——申购差价收入	—
合计	6,275.57

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	17,291.81

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	11,000.00
减：应计利息总额	1.07
减：交易费用	17.29
买卖债券差价收入	6,273.45

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	326,655.25
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	326,655.25

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	3,417,910.63
股票投资	3,413,957.62
债券投资	3,953.01
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	3,417,910.63
----	--------------

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	14,543.00
合计	14,543.00

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	9,916.99
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行费用	130.00
IOPV 计算与发布费用	3,571.60
注册登记费用	59,507.37
合计	112,797.54

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

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。

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)	基金管理人的股东

Asset Management. L. P.)	
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
华宝创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (“华宝创业板综合增强策略 ETF 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。

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
当期发生的基金应支付的管理费	142,373.47
其中：应支付销售机构的客户维护费	48,885.24
应支付基金管理人的净管理费	93,488.23

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 $\times$ 0.5% / 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
当期发生的基金应支付的托管费	28,474.70

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 0.1% 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 $\times$ 0.1% / 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—华宝创业板综指增强型发起式证券投资基金	156,805,300.00	83.77	—	—

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
兴业银行	200,010.37	181.93

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

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

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	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股锁定	28.00	27.78	15	420.00	416.70	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
123273	三江转债	2026 年 6 月 17 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.01	73	7,300.00	7,300.45	-

6.4.12.2 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。

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

本基金为指数增强 ETF 基金，在对标的指数进行有效跟踪的基础上，力争获得超越业绩比较基准的超额收益。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。

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同责任，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）

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该比例限制）。

本基金所持证券均在证券交易所上市，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。本基金所持证券均在证券交易所上市，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；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	200,010.37	-	-	-	200,010.37
结算备付金	1,159,880.74	-	-	-	1,159,880.74
交易性金融资产	-	-	18,154.06	251,982,816.32	252,000,970.38
其他资产	-	-	-	60,492.63	60,492.63
资产总计	1,359,891.11	-	18,154.06	252,043,308.95	253,421,354.12
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	31,086.46	31,086.46
应付托管费	-	-	-	6,217.30	6,217.30

应交税费	-	-	-	0.75	0.75
其他负债	-	-	-	55,217.57	55,217.57
负债总计	-	-	-	92,522.08	92,522.08
利率敏感度缺口	1,359,891.11	-	18,154.06	251,950,786.87	253,328,832.04
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	200,024.12	-	-	-	200,024.12
结算备付金	321,475.72	-	-	-	321,475.72
交易性金融资产	-	-	-	70,098,039.99	70,098,039.99
资产总计	521,499.84	-	-	70,098,039.99	70,619,539.83
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	33,937.64	33,937.64
应付托管费	-	-	-	6,787.53	6,787.53
其他负债	-	-	-	60,000.00	60,000.00
负债总计	-	-	-	100,725.17	100,725.17
利率敏感度缺口	521,499.84	-	-	69,997,314.82	70,518,814.66

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，本基金持有交易性债券投资比例较低(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的股票，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。

本基金通过数量化的投资策略模型精选创业板优质股票，在对标的指数进行有效跟踪的基础上，力争获得超越业绩比较基准的超额收益。本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于创业板综合指数成分股及备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%。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	251,982,816.32	99.47	70,098,039.99	99.40
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	251,982,816.32	99.47	70,098,039.99	99.40

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于报告期末，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

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	251,993,253.23	70,075,428.38
第二层次	7,300.45	—
第三层次	416.70	22,611.61

合计	252,000,970.38	70,098,039.99
----	----------------	---------------

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	251,982,816.32	99.43
	其中：股票	251,982,816.32	99.43
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	18,154.06	0.01
	其中：债券	18,154.06	0.01
	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	1,359,891.11	0.54
8	其他各项资产	60,492.63	0.02
9	合计	253,421,354.12	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	1,765,392.60	0.70
B	采矿业	385,002.00	0.15
C	制造业	205,363,440.92	81.07
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	9,263,782.70	3.66
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	16,925,708.00	6.68
J	金融业	5,986,137.00	2.36
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	1,614,412.40	0.64
M	科学研究和技术服务业	4,114,180.00	1.62
N	水利、环境和公共设施管理业	3,122,410.00	1.23
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	278,235.00	0.11
Q	卫生和社会工作	2,745,007.00	1.08
R	文化、体育和娱乐业	418,692.00	0.17
S	综合	—	—
	合计	251,982,399.62	99.47

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	-	-
C	制造业	-	-
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	416.70	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	416.70	0.00

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	300750	宁德时代	59,500	23,384,095.00	9.23
2	300308	中际旭创	17,000	21,590,000.00	8.52
3	300502	新易盛	19,540	11,860,780.00	4.68
4	300408	三环集团	36,900	6,158,610.00	2.43
5	300394	天孚通信	17,200	5,206,096.00	2.06
6	301308	江波龙	6,700	4,715,460.00	1.86

7	300857	协创数据	13,180	4,479,882.00	1.77
8	300604	长川科技	12,800	4,370,176.00	1.73
9	300475	香农芯创	13,900	4,170,000.00	1.65
10	300476	胜宏科技	11,800	4,087,874.00	1.61
11	300223	北京君正	15,500	3,857,950.00	1.52
12	300274	阳光电源	23,600	3,752,872.00	1.48
13	300442	润泽科技	39,800	3,306,186.00	1.31
14	300014	亿纬锂能	47,600	3,095,428.00	1.22
15	300033	同花顺	11,940	2,877,540.00	1.14
16	300373	扬杰科技	18,000	2,830,140.00	1.12
17	300054	鼎龙股份	24,600	2,606,862.00	1.03
18	301536	星宸科技	18,600	2,394,006.00	0.95
19	301358	湖南裕能	30,600	2,321,622.00	0.92
20	300059	东方财富	110,700	2,256,066.00	0.89
21	300395	菲利华	16,300	2,179,799.00	0.86
22	300613	富瀚微	26,700	2,138,136.00	0.84
23	300438	鹏辉能源	25,300	2,096,105.00	0.83
24	300433	蓝思科技	38,500	2,065,910.00	0.82
25	300458	全志科技	51,840	2,045,606.40	0.81
26	300861	美畅股份	75,300	1,896,807.00	0.75
27	300919	中伟新材	42,900	1,876,875.00	0.74
28	300277	汽轮科技	114,300	1,719,072.00	0.68
29	300972	万辰集团	9,700	1,682,077.00	0.66
30	301377	鼎泰高科	3,000	1,652,700.00	0.65
31	300953	震裕科技	12,200	1,631,140.00	0.64
32	300236	上海新阳	12,300	1,617,450.00	0.64
33	300434	金石亚药	133,600	1,500,328.00	0.59
34	301275	汉朔科技	32,700	1,468,230.00	0.58
35	300390	天华新能	15,700	1,468,107.00	0.58
36	301345	涛涛车业	6,300	1,455,300.00	0.57
37	300073	当升科技	30,100	1,446,004.00	0.57
38	300590	移为通信	100,600	1,443,610.00	0.57
39	300037	新宙邦	15,400	1,429,890.00	0.56
40	301662	宏工科技	13,700	1,388,084.00	0.55
41	301055	张小泉	31,600	1,342,052.00	0.53
42	301371	敷尔佳	50,600	1,315,600.00	0.52
43	301219	腾远钴业	23,890	1,309,172.00	0.52
44	301122	采纳股份	43,900	1,291,099.00	0.51
45	300738	奥飞数据	63,700	1,288,014.00	0.51
46	300823	建科智能	87,500	1,275,750.00	0.50
47	300398	飞凯材料	19,600	1,210,300.00	0.48
48	300801	泰和科技	36,600	1,182,180.00	0.47
49	300002	神州泰岳	150,900	1,178,529.00	0.47

50	300628	亿联网络	34,800	1,176,936.00	0.46
51	300015	爱尔眼科	141,800	1,171,268.00	0.46
52	301665	泰禾股份	55,822	1,170,029.12	0.46
53	301150	中一科技	18,200	1,148,602.00	0.45
54	301239	普瑞眼科	37,500	1,141,875.00	0.45
55	300012	华测检测	81,800	1,133,748.00	0.45
56	301031	中熔电气	9,408	1,123,785.60	0.44
57	301500	飞南资源	42,700	1,112,335.00	0.44
58	300548	长芯博创	4,000	1,112,000.00	0.44
59	301101	明月镜片	40,600	1,105,944.00	0.44
60	300789	唐源电气	61,600	1,094,632.00	0.43
61	300034	钢研高纳	63,700	1,091,818.00	0.43
62	300512	中亚股份	158,200	1,078,924.00	0.43
63	300760	迈瑞医疗	7,900	1,073,057.00	0.42
64	300428	立中集团	58,500	1,063,530.00	0.42
65	301116	益客食品	122,700	1,050,312.00	0.41
66	300865	大宏立	47,900	1,046,615.00	0.41
67	301606	绿联科技	17,000	1,037,340.00	0.41
68	300832	新产业	24,100	1,012,200.00	0.40
69	301200	大族数控	2,800	1,009,820.00	0.40
70	300008	天海防务	163,200	988,992.00	0.39
71	301015	百洋医药	51,700	985,402.00	0.39
72	300866	安克创新	9,400	982,300.00	0.39
73	301608	博实结	19,425	976,300.50	0.39
74	300681	英搏尔	34,000	973,080.00	0.38
75	300768	迪普科技	70,200	966,654.00	0.38
76	300124	汇川技术	14,500	961,785.00	0.38
77	300042	朗科科技	12,400	944,508.00	0.37
78	301060	兰卫医学	114,500	935,465.00	0.37
79	301048	金鹰重工	108,400	933,324.00	0.37
80	300302	同有科技	18,100	926,177.00	0.37
81	300323	华灿光电	45,400	926,160.00	0.37
82	301339	通行宝	90,300	923,769.00	0.36
83	300511	雪榕生物	180,800	909,424.00	0.36
84	300743	天地数码	60,600	884,154.00	0.35
85	300388	节能国祯	142,800	881,076.00	0.35
86	300489	光智科技	2,800	873,460.00	0.34
87	300822	贝仕达克	74,400	870,480.00	0.34
88	300445	康斯特	41,600	866,112.00	0.34
89	301019	宁波色母	48,000	855,840.00	0.34
90	300803	指南针	9,300	852,531.00	0.34
91	300422	博世科	199,800	841,158.00	0.33
92	300596	利安隆	15,900	834,432.00	0.33

93	300662	科锐国际	48,200	818,436.00	0.32
94	300500	启迪设计	92,400	815,892.00	0.32
95	300406	九强生物	74,400	813,192.00	0.32
96	301032	新柴股份	79,800	742,140.00	0.29
97	300424	航新科技	46,800	736,632.00	0.29
98	301156	美农生物	67,370	732,311.90	0.29
99	300693	盛弘股份	15,000	731,250.00	0.29
100	301085	亚康股份	11,800	715,198.00	0.28
101	301600	慧翰股份	7,500	685,500.00	0.27
102	300970	华绿生物	37,220	680,381.60	0.27
103	300187	永清环保	134,400	678,720.00	0.27
104	300184	力源信息	38,354	673,112.70	0.27
105	301535	浙江华远	49,500	664,290.00	0.26
106	300030	阳普医疗	113,900	661,759.00	0.26
107	301260	格力博	48,300	652,533.00	0.26
108	300450	先导智能	15,200	618,944.00	0.24
109	300769	德方纳米	9,300	618,450.00	0.24
110	300206	理邦仪器	50,200	613,946.00	0.24
111	300509	新美星	73,200	613,416.00	0.24
112	300933	中辰股份	98,100	596,448.00	0.24
113	300270	中威电子	44,800	582,848.00	0.23
114	300226	上海钢联	35,840	548,710.40	0.22
115	301292	海科新源	6,800	542,164.00	0.21
116	301043	绿岛风	11,000	540,210.00	0.21
117	300154	瑞凌股份	71,400	536,928.00	0.21
118	301548	崇德科技	5,900	523,743.00	0.21
119	301215	中汽股份	100,500	521,595.00	0.21
120	300153	科泰电源	22,800	515,736.00	0.20
121	301559	中集环科	39,700	483,943.00	0.19
122	301510	固高科技	15,100	482,143.00	0.19
123	300797	钢研纳克	36,200	480,012.00	0.19
124	300490	华自科技	35,900	474,957.00	0.19
125	301246	宏源药业	17,600	473,440.00	0.19
126	300564	筑博设计	38,500	462,385.00	0.18
127	300867	圣元环保	25,100	454,812.00	0.18
128	300699	光威复材	15,400	441,210.00	0.17
129	300771	智莱科技	42,500	438,600.00	0.17
130	301392	汇成真空	1,500	432,960.00	0.17
131	301267	华夏眼科	29,600	431,864.00	0.17
132	300043	星辉娱乐	99,000	430,650.00	0.17
133	300487	蓝晓科技	7,300	429,605.00	0.17
134	301589	诺瓦星云	2,700	402,246.00	0.16
135	300988	津荣天宇	25,600	400,128.00	0.16

136	301217	铜冠铜箔	2,400	396,168.00	0.16
137	301266	宇邦新材	17,100	390,564.00	0.15
138	300503	昊志机电	4,200	387,660.00	0.15
139	301059	金三江	34,800	385,932.00	0.15
140	300483	首华燃气	21,900	385,002.00	0.15
141	301087	可孚医疗	7,700	366,905.00	0.14
142	301222	浙江恒威	12,200	365,512.00	0.14
143	300405	科隆股份	70,300	364,154.00	0.14
144	301329	信音电子	14,900	361,921.00	0.14
145	301261	恒工精密	4,600	359,260.00	0.14
146	301297	富乐德	5,800	355,192.00	0.14
147	300556	丝路视觉	19,900	345,663.00	0.14
148	300583	赛托生物	28,800	323,424.00	0.13
149	300999	金龙鱼	13,800	320,988.00	0.13
150	300067	安诺其	56,300	305,146.00	0.12
151	300142	沃森生物	23,100	300,069.00	0.12
152	300684	中石科技	4,800	292,800.00	0.12
153	300727	润禾材料	7,700	288,134.00	0.11
154	300357	我武生物	12,300	286,836.00	0.11
155	300971	博亚精工	15,300	285,498.00	0.11
156	300113	顺网科技	15,300	278,613.00	0.11
157	300492	华图山鼎	8,100	278,235.00	0.11
158	300723	一品红	7,400	275,872.00	0.11
159	301190	善水科技	17,200	275,716.00	0.11
160	301321	翰博高新	6,100	269,315.00	0.11
161	301109	军信股份	21,400	266,644.00	0.11
162	300454	深信服	2,700	259,740.00	0.10
163	300945	曼卡龙	23,900	258,837.00	0.10
164	300975	商络电子	5,000	258,750.00	0.10
165	300307	慈星股份	34,600	255,002.00	0.10
166	300629	新劲刚	11,600	248,936.00	0.10
167	300757	罗博特科	400	247,600.00	0.10
168	300233	金城医药	19,800	245,520.00	0.10
169	300504	天邑股份	14,800	238,724.00	0.09
170	301097	天益医疗	6,560	234,192.00	0.09
171	301216	万凯新材	10,100	232,199.00	0.09
172	300674	宇信科技	15,400	231,770.00	0.09
173	300346	南大光电	2,500	231,625.00	0.09
174	300785	值得买	6,300	231,021.00	0.09
175	301273	瑞晨环保	7,200	226,872.00	0.09
176	301136	招标股份	20,200	221,796.00	0.09
177	301025	读客文化	28,500	221,160.00	0.09
178	301083	百胜智能	16,500	217,305.00	0.09

179	301268	铭利达	15,400	215,292.00	0.08
180	300141	和顺电气	22,800	214,092.00	0.08
181	301189	奥尼电子	3,580	210,969.40	0.08
182	301100	风光股份	15,100	209,890.00	0.08
183	300155	安居宝	53,300	208,936.00	0.08
184	300625	三雄极光	23,000	208,840.00	0.08
185	300575	中旗股份	41,400	203,688.00	0.08
186	300701	森霸传感	21,200	202,884.00	0.08
187	301408	华人健康	13,900	199,882.00	0.08
188	300133	华策影视	27,900	197,532.00	0.08
189	300281	金明精机	32,700	197,181.00	0.08
190	300773	拉卡拉	12,700	194,310.00	0.08
191	300607	拓斯达	4,600	189,658.00	0.07
192	300957	贝泰妮	6,000	189,060.00	0.07
193	300658	延江股份	16,500	188,595.00	0.07
194	300761	立华股份	10,700	175,587.00	0.07
195	300661	圣邦股份	1,200	172,176.00	0.07
196	300824	北鼎股份	23,200	166,576.00	0.07
197	300283	温州宏丰	8,100	166,455.00	0.07
198	300482	万孚生物	9,900	164,439.00	0.06
199	300573	兴齐眼药	4,025	164,059.00	0.06
200	300380	安硕信息	5,300	163,081.00	0.06
201	300795	米奥会展	17,100	146,376.00	0.06
202	300770	新媒股份	4,100	129,109.00	0.05
203	301429	森泰股份	7,800	122,226.00	0.05
204	301256	华融化学	9,300	120,528.00	0.05
205	300381	溢多利	19,100	107,342.00	0.04
206	301102	兆讯传媒	11,800	100,890.00	0.04
207	300650	太龙股份	6,900	100,257.00	0.04
208	301396	宏景科技	300	99,480.00	0.04
209	300358	楚天科技	12,300	98,400.00	0.04
210	301283	聚胶股份	3,700	90,576.00	0.04
211	300466	赛摩智能	12,500	88,000.00	0.03
212	300306	远方信息	9,000	87,300.00	0.03
213	300515	三德科技	6,500	84,825.00	0.03
214	301165	锐捷网络	1,000	80,450.00	0.03
215	300459	汤姆猫	23,600	80,004.00	0.03
216	301110	青木科技	2,100	79,506.00	0.03
217	300407	凯发电气	7,300	78,840.00	0.03
218	300320	海达股份	7,800	74,412.00	0.03
219	301213	观想科技	1,500	73,710.00	0.03
220	300253	卫宁健康	10,800	72,684.00	0.03
221	300284	苏交科	14,200	71,000.00	0.03

222	300432	富临精工	3,000	60,270.00	0.02
223	300839	博汇股份	4,800	56,208.00	0.02
224	301028	鼎熔岩	3,500	55,860.00	0.02
225	300404	博济医药	6,000	52,560.00	0.02
226	300387	富邦科技	7,700	52,283.00	0.02
227	300415	伊之密	2,200	43,802.00	0.02
228	301056	森赫股份	3,900	43,680.00	0.02

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	001220	世盟股份	15	416.70	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	2,195,517.00	3.11
2	301377	鼎泰高科	1,905,322.93	2.70
3	300014	亿纬锂能	1,650,949.00	2.34
4	300476	胜宏科技	1,360,134.00	1.93
5	300394	天孚通信	1,324,477.00	1.88
6	300450	先导智能	1,274,799.00	1.81
7	301308	江波龙	1,243,996.00	1.76
8	300408	三环集团	1,148,462.00	1.63
9	300604	长川科技	1,091,463.00	1.55
10	300857	协创数据	1,083,884.00	1.54
11	300803	指南针	1,021,406.00	1.45
12	300433	蓝思科技	1,021,290.00	1.45
13	301200	大族数控	991,629.00	1.41
14	300760	迈瑞医疗	972,130.00	1.38
15	300037	新宙邦	896,567.00	1.27
16	300475	香农芯创	858,578.00	1.22
17	300207	欣旺达	849,491.00	1.20
18	300442	润泽科技	743,428.00	1.05
19	300489	光智科技	741,605.00	1.05
20	300613	富瀚微	686,885.00	0.97

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	2,652,409.00	3.76

2	300308	中际旭创	2,453,694.00	3.48
3	300014	亿纬锂能	1,638,515.00	2.32
4	300394	天孚通信	1,450,808.00	2.06
5	300442	润泽科技	1,346,877.00	1.91
6	300476	胜宏科技	1,178,462.00	1.67
7	301308	江波龙	1,118,184.00	1.59
8	300802	矩子科技	962,194.00	1.36
9	300017	网宿科技	944,253.00	1.34
10	300001	特锐德	903,584.00	1.28
11	300407	凯发电气	857,477.00	1.22
12	300409	道氏技术	848,126.00	1.20
13	301031	中熔电气	831,784.60	1.18
14	300274	阳光电源	829,819.00	1.18
15	300916	朗特智能	826,113.00	1.17
16	300604	长川科技	821,802.00	1.17
17	301035	润丰股份	810,586.00	1.15
18	300972	万辰集团	807,396.00	1.14
19	300760	迈瑞医疗	806,254.00	1.14
20	301606	绿联科技	781,422.00	1.11

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	131,494,929.77
卖出股票收入（成交）总额	131,267,715.73

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	18,154.06	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	18,154.06	0.01

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	123272	中汽转债	69	10,853.61	0.00
2	123273	三江转债	73	7,300.45	0.00

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

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。

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	—
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	60,492.63

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	001220	世盟股份	416.70	0.00	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（%）
651	287,541.52	162,925,765.00	87.04	24,263,766.00	12.96

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－华宝创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	156,805,300.00	83.77

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（2025 年 8 月 20 日） 基金份额总额	514,189,531.00
本报告期期初基金份额总额	64,189,531.00
本报告期基金总申购份额	177,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	54,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	187,189,531.00

§ 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：自 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 (%)	
申万宏源	4	262,758,501.50	100.00	48,863.62	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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)

						例 (%)
申万宏源	17, 291. 81	100. 00	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华宝创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2026-01-22
2	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联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	2026-02-10
3	华宝创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2025 年年度报告	基金管理人网站	2026-03-31
4	华宝创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金 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
6	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
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东方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	2026-06-29

§ 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-华宝创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1	20260624~20260630	0.00	156, 805, 300. 00	0.00	156, 805, 300. 00	83. 77
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；

华宝创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同；

华宝创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金招募说明书；

华宝创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金托管协议；

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