

华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资 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：中国民生银行股份有限公司

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。

基金托管人中国民生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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
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	11
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	12
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）	13
6.1 资产负债表	13
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	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
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	58
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	58
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	58

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	58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
7.12 投资组合报告附注	59
§ 8 基金份额持有人信息	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
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	60
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	61
§ 9 开放式基金份额变动	61
§ 10 重大事件揭示	61
10.1 基金份额持有人大会决议	61
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	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
10.4 基金投资策略的改变	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	62
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	62
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	62
10.8 其他重大事件	63
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	64
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	64
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	64
§ 12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录	64
12.2 存放地点	65
12.3 查阅方式	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	华宝中证 500 增强	
基金主代码	005607	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 4 月 19 日	
基金管理人	华宝基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	47,110,053.43 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华宝中证 500 增强 A	华宝中证 500 增强 C
下属分级基金的交易代码	005607	005608
报告期末下属分级基金的份额总额	30,527,667.61 份	16,582,385.82 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为中证 500 指数增强型基金，在实现中证 500 指数有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的组合配置和管理，力争实现超越标的指数的投资收益。
投资策略	本基金主要投资于中证 500 指数成分股及备选股票，也会根据中证 500 股指期货的基差情况择机部分使用期货替代现货，降低成本。视市场情况本基金也会谨慎地参与一些绝对收益策略。同时，本基金将预留必要的现金，应对期货保证金的增加要求或投资者的赎回申请。本基金主要采用量化行业配置模型和量化 Alpha 选股模型构建指数增强股票组合。在控制跟踪偏离度的前提下力争实现超额表现，并根据市场变化趋势，定期对模型进行调整，以改进模型的有效性。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于高预期风险、高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华宝基金管理有限公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周雷	林盛
	联系电话	021-38505888	010-58560666
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	tgxxpl@cmbc.com.cn
客户服务电话		400-700-5588、400-820-5050	95568
传真		021-38505777	010-57093382

注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区复兴门内大街 2 号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区复兴门内大街 2 号
邮政编码	200120	100031
法定代表人	夏雪松	高迎欣

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	基金管理人	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

§ 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)	
	华宝中证 500 增强 A	华宝中证 500 增强 C
本期已实现收益	3,043,985.58	2,392,972.72
本期利润	4,660,541.04	3,919,066.48
加权平均基金份额 本期利润	0.2106	0.2073
本期加权平均净 值利润率	12.96%	13.24%
本期基金份额净 值增长率	16.50%	16.27%
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	22,824,435.70	11,460,228.03

期末可供分配基金份额利润	0.7477	0.6911
期末基金资产净值	53,352,103.31	28,042,613.85
期末基金份额净值	1.7477	1.6911
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	74.77%	69.11%

- 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

华宝中证 500 增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	16.11%	1.49%	17.61%	1.56%	-1.50%	-0.07%
过去六个月	16.50%	1.47%	19.93%	1.58%	-3.43%	-0.11%
过去一年	43.94%	1.23%	49.68%	1.35%	-5.74%	-0.12%
过去三年	52.86%	1.33%	48.15%	1.41%	4.71%	-0.08%
过去五年	33.17%	1.24%	31.61%	1.30%	1.56%	-0.06%
过去七年	101.53%	1.25%	78.59%	1.29%	22.94%	-0.04%
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	74.77%	1.29%	49.79%	1.34%	24.98%	-0.05%

华宝中证 500 增强 C

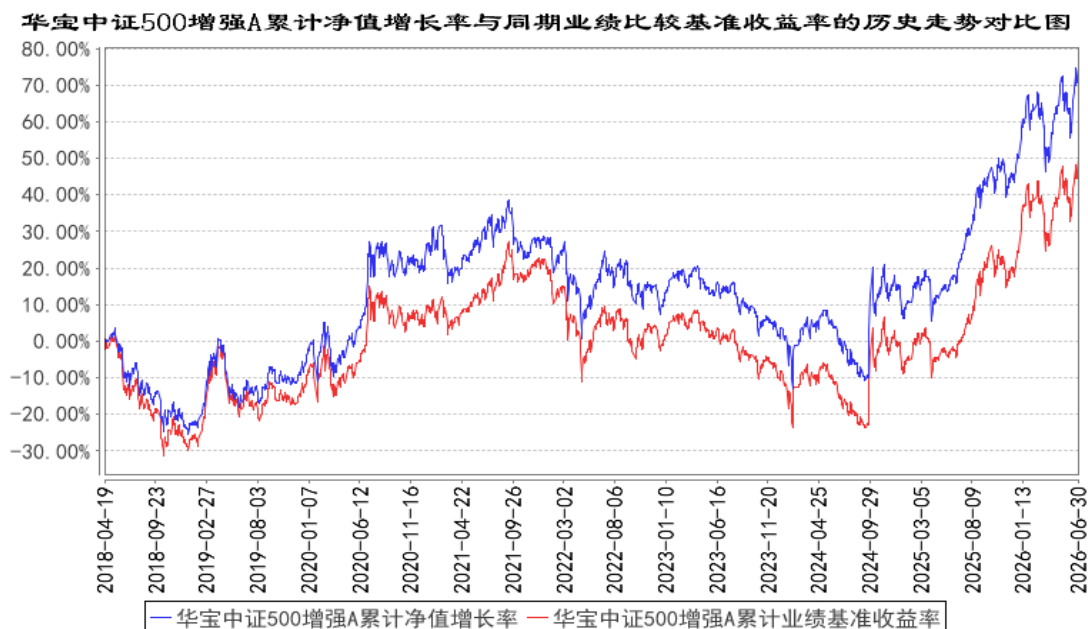
阶段	份额净值增	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基	①－③	②－④
----	-------	-------	-------	-------	-----	-----

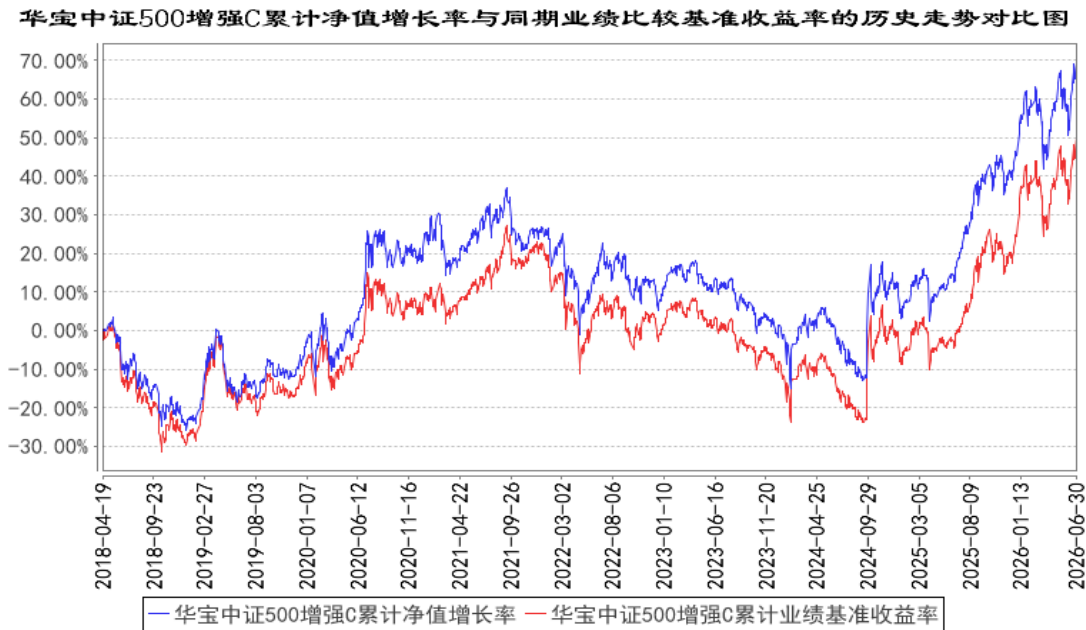
	长率①	长率标准差 ②	准收益率③	准收益率标 准差④		
过去三个月	16.00%	1.49%	17.61%	1.56%	-1.61%	-0.07%
过去六个月	16.27%	1.46%	19.93%	1.58%	-3.66%	-0.12%
过去一年	43.36%	1.23%	49.68%	1.35%	-6.32%	-0.12%
过去三年	51.03%	1.33%	48.15%	1.41%	2.88%	-0.08%
过去五年	30.51%	1.24%	31.61%	1.30%	-1.10%	-0.06%
过去七年	95.93%	1.25%	78.59%	1.29%	17.34%	-0.04%
过去十年	—	—	—	—	—	—
自基金合同 生效起至今	69.11%	1.29%	49.79%	1.34%	19.32%	-0.05%

注：（1）基金业绩基准：中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%；

（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 2018 年 10 月 19 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		
姜松尚	本基金基金经理	2025-12-31	-	5 年	硕士。曾在兴银基金管理有限责任公司从事投研工作。2025 年 10 月加入华宝基金管理有限公司，任指数研发投资部指数资深分析师。2025 年 12 月起任华宝中

					证 500 指数增强型发起式证券投资基金、华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金、华宝科技先锋混合型证券投资基金基金经理。
喻银尤	本基金基金经理	2022-07-05	2026-01-22	10 年	硕士。曾在中信建投证券股份有限公司从事量化研究工作，2018 年 9 月加入华宝基金管理有限公司，历任量化分析师、投资经理等职务。2022 年 7 月至 2026 年 1 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，2023 年 2 月起任华宝量化选股混合型发起式证券投资基金基金经理，2025 年 3 月至 2026 年 4 月任华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2025 年 6 月起任华宝中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理，2025 年 9 月起任华宝上证科创板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金联接基金（原：华宝上证科创板综合指数增强型证券投资基金）基金经理，2026 年 3 月起任华宝价值发现混合型证券投资基金基金经理，2026 年 5 月起任华宝上证科创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。

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、《华宝中证 500 指数增强型发起式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

资产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 A 股市场呈现显著的结构性分化特征。三大指数全线收涨，上证指数上涨 3.16% 站上 4000 点。在科技成长风格带动下，市场成交活跃，AI 硬科技全产业链（半导体设备、光模块、芯片等）成为主线。消费、红利等板块则相对表现平淡，市场个股分化明显。本基金采用量化方法持续挖掘优质个股，采用较严格的风险控制策略，不押注特定风格与行业，追求稳健超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额 A 类净值增长率为 16.50%，本报告期基金份额 C 类净值增长率为 16.27%；同期业绩比较基准收益率为 19.93%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济方面，全球经济呈现“K 型分化”，地缘冲突推升通胀中枢，美联储加息预期将是市场未来博弈关键，若美联储降息路径在三季度逐步明朗，全球风险偏好回暖将为 A 股提供外部支撑。国内经济新旧动能转换势头不变，政策上或将保持适度宽松并聚焦新质生产力。市场方面，A 股“结构性慢牛”格局未变，但上半年极致分化后波动料将加剧，风格或从单一抱团转向适度均衡。叠加中报季业绩验证期到来，盈利韧性较强的板块有望脱颖而出。

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

截至本报告期末，本基金基金资产净值存在连续超过六十个工作日低于五千万元的情形。根据相关规定，本基金管理人已拟定了相应的解决方案，并将方案报告监管机构。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，按照相关法律法规规定和基金合同、托管协议的有关约定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的约定进行。

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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“各关联方投资本基金的情况”和“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、准确和完整。

§ 6 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 500 指数增强型发起式证券投资基金

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	1,714,875.63	1,147,980.58
结算备付金		5,729,713.20	2,843,207.44
存出保证金		428,553.60	-
交易性金融资产	6.4.7.2	73,748,097.47	43,509,986.74
其中：股票投资		73,748,097.47	43,509,986.74
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		171,487.16	119,654.83
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		81,792,727.06	47,620,829.59
负债和净资产			
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		289,789.42	554,708.02

应付管理人报酬		63,605.80	38,889.06
应付托管费		7,632.67	4,666.69
应付销售服务费		8,711.67	8,249.23
应付投资顾问费		-	-
应交税费		18.58	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	28,251.76	53,467.46
负债合计		398,009.90	659,980.46
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	47,110,053.43	31,837,158.30
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	34,284,663.73	15,123,690.83
净资产合计		81,394,717.16	46,960,849.13
负债和净资产总计		81,792,727.06	47,620,829.59

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 47,110,053.43 份，其中华宝中证 500 增强 A 基金份额总额 30,527,667.61 份，基金份额净值 1.7477 元；华宝中证 500 增强 C 基金份额总额 16,582,385.82 份，基金份额净值 1.6911 元。

6.2 利润表

会计主体：华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

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		9,023,250.59	3,611,646.12
1. 利息收入		9,379.73	3,731.85
其中：存款利息收入	6.4.7.9	9,379.73	3,731.85
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）		5,779,140.53	915,389.41
其中：股票投资收益	6.4.7.10	5,433,920.97	596,105.81
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	-10,678.54	-55,953.91
股利收益	6.4.7.15	355,898.10	375,237.51
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	3,142,649.22	2,677,697.08
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	92,081.11	14,827.78
减：二、营业总支出		443,643.07	317,157.09
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	323,041.90	206,397.49
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	38,765.07	24,767.69
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	58,438.51	48,697.84
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		544.15	58.16
8. 其他费用	6.4.7.19	22,853.44	37,235.91
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		8,579,607.52	3,294,489.03
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		8,579,607.52	3,294,489.03
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		8,579,607.52	3,294,489.03

6.3 净资产变动表

会计主体：华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

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	31,837,158.30	—	15,123,690.83	46,960,849.13
加：会计政策变更	—	—	—	—
前期差错更正	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
二、本期期初净资产	31,837,158.30	—	15,123,690.83	46,960,849.13
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	15,272,895.13	—	19,160,972.90	34,433,868.03
（一）、综合收益总额	—	—	8,579,607.52	8,579,607.52
（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）	15,272,895.13	—	10,581,365.38	25,854,260.51
其中：1. 基金申购款	49,366,974.66	—	30,226,472.28	79,593,446.94
2. 基金赎回款	-34,094,079.53	—	-19,645,106.90	-53,739,186.43
（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	47,110,053.43	—	34,284,663.73	81,394,717.16
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	43,431,475.71	—	4,521,367.91	47,952,843.62
加：会计政策变更	—	—	—	—

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	43,431,475.71	-	4,521,367.91	47,952,843.62
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-11,373,137.94	-	1,678,442.06	-9,694,695.88
（一）、综合收益总额	-	-	3,294,489.03	3,294,489.03
（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）	-11,373,137.94	-	-1,616,046.97	-12,989,184.91
其中：1. 基金申购款	5,138,689.39	-	658,138.67	5,796,828.06
2. 基金赎回款	-16,511,827.33	-	-2,274,185.64	-18,786,012.97
（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	32,058,337.77	-	6,199,809.97	38,258,147.74

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

华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金（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[2018]第 15 号《关于准予华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》准予注册，由华宝基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝中证 500 指数增强型发起式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发起式，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 55,152,857.21 元，业经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)德师报(验)字(18)第 00004 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于 2018 年 4 月 19 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 55,157,340.21 份基金份额，其中认购资金利息折合 4,483.00 份基金份额。本基金的基金管理人为华宝基金管理有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据经批准的《华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》和《华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》的规定，本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票(包含中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、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、权证、资产支持证券、股指期货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)。本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中证 500 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%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金投资股指期货、权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人华宝基金管理有限公司于 2026 年 8 月 27 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《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》及中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

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财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 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基金净资产变动情况。

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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016] 140 号文《关于明确金融、

房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税〔2017〕2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税〔2017〕56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税〔2017〕90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税〔2023〕39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税〔2025〕4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税〔2026〕10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 本基金管理人运营本基金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% 的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，截至 2027 年 12 月 31 日，免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对本基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对本基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

d) 本基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

e) 对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本基金管理人所在地适用的税率，计算

缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

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	1,714,875.63
等于：本金	1,714,702.69
加：应计利息	172.94
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	1,714,875.63

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	70,124,014.57	-	73,748,097.47	3,624,082.90
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	70,124,014.57	-	73,748,097.47	3,624,082.90

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	3,245,986.68	-	-	
其中：股指期货投资	3,245,986.68	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	3,245,986.68	-	-	

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2607	IC2607	2.00	3,571,280.00	325,293.32
合计				325,293.32
减：可抵销期货暂收款				325,293.32
净额				0.00

注：（1）买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

（2）衍生金融资产项下的利率/权益/其他衍生工具为国债/股指/商品期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指/商品/国债期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指/商品/国债期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

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

本基金本报告期末未持有其他资产。

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	248.83
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	21,488.39
其他	6,514.54
合计	28,251.76

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

华宝中证 500 增强 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	14,314,612.20	14,314,612.20
本期申购	28,525,521.05	28,525,521.05
本期赎回（以“-”号填列）	-12,312,465.64	-12,312,465.64
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	30,527,667.61	30,527,667.61

华宝中证 500 增强 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	17,522,546.10	17,522,546.10
本期申购	20,841,453.61	20,841,453.61
本期赎回（以“-”号填列）	-21,781,613.89	-21,781,613.89
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	16,582,385.82	16,582,385.82

注：申购含红利再投以及转换入份(金)额，赎回含转换出份(金)额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

华宝中证 500 增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	8,913,852.81	-1,754,193.74	7,159,659.07
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	8,913,852.81	-1,754,193.74	7,159,659.07
本期利润	3,043,985.58	1,616,555.46	4,660,541.04
本期基金份额交易产生的变动数	11,800,383.25	-796,147.66	11,004,235.59
其中：基金申购款	20,786,687.28	-2,391,555.97	18,395,131.31
基金赎回款	-8,986,304.03	1,595,408.31	-7,390,895.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	23,758,221.64	-933,785.94	22,824,435.70

华宝中证 500 增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	10,073,045.45	-2,109,013.69	7,964,031.76
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	10,073,045.45	-2,109,013.69	7,964,031.76
本期利润	2,392,972.72	1,526,093.76	3,919,066.48
本期基金份额交易产生的变动数	-486,246.41	63,376.20	-422,870.21
其中：基金申购款	13,957,727.76	-2,126,386.79	11,831,340.97
基金赎回款	-14,443,974.17	2,189,762.99	-12,254,211.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,979,771.76	-519,543.73	11,460,228.03

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	2,852.42
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	6,480.25
其他	47.06
合计	9,379.73

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 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	483,574,047.06
减：卖出股票成本总额	477,646,180.74
减：交易费用	493,945.35
买卖股票差价收入	5,433,920.97

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买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-10,678.54

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	355,898.10
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	355,898.10

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	2,817,355.90
股票投资	2,817,355.90
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	325,293.32
权证投资	-
期货投资	325,293.32
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	3,142,649.22

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	88,339.47
基金转换费收入	3,741.64
合计	92,081.11

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	4,958.58
信息披露费	16,529.81
证券出借违约金	-
银行费用	1,362.03
存托服务费	3.02
合计	22,853.44

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, 注册登记机构, 基金销售机构
中国民生银行股份有限公司(“民生银行”)	基金托管人, 基金销售机构
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

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	323, 041. 90	206, 397. 49
其中：应支付销售机构的客户维护费	105, 228. 27	68, 210. 67
应支付基金管理人的净管理费	217, 813. 63	138, 186. 82

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 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：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 ×1% / 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	38,765.07	24,767.69

注：支付基金托管民生银行的托管费按前一日基金资产净值 0.12%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 × 0.12% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华宝中证 500 增强 A	华宝中证 500 增强 C	合计
华宝基金	-	1,184.70	1,184.70
华宝证券	-	8,237.94	8,237.94
民生银行	-	1,378.63	1,378.63
合计	-	10,801.27	10,801.27
获得销售服务费的各关联方名称	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销售服务费		
	华宝中证 500 增强 A	华宝中证 500 增强 C	合计
华宝基金	-	857.11	857.11
华宝证券	-	9,132.32	9,132.32
民生银行	-	1,233.52	1,233.52
合计	-	11,222.95	11,222.95

注：销售服务费每日计提，按月支付。A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.4%年费率计提。本基金 C 类基金份额销售服务费计提的计算方法如下： $H=E\times 0.4\%\div \text{当年天数}$ ，H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费 E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值。

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

份额单位：份

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	华宝中证 500 增强 A	华宝中证 500 增强 C
基金合同生效日 (2018 年 4 月 19 日) 持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/ 买入总份额	-	-
报告期间因拆分 变动份额	-	-
减：报告期间赎回/ 卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的 基金份额 占基金总份额比例	-	-
项目	上年度可比期间	
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	华宝中证 500 增强 A	华宝中证 500 增强 C
基金合同生效日 (2018 年 4 月 19 日) 持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	3,000,450.05	-
报告期间申购/	0.00	-

买入总份额		
报告期间因拆分变动份额	0.00	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	3,000,450.05	—
报告期末持有的基金份额	0.00	—
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	—

注：基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

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

本报告期末及上年度末除基金管理人外其他关联方未投资本基金。

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
民生银行	1,714,875.63	2,852.42	45,886.47	1,710.99

注：本基金的银行存款由基金托管人民生银行保管，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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

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

本基金为指数增强型基金，在实现对中证 500 指数有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的组合配置和管理，力争实现超越标的指数的投资收益。本基金属于高预期风险、高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、股指期货等。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“风险和收益相匹配”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结合定性分析和定量分析方法，估计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一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

于本报告期末，除附注中列示的卖出回购金融资产款将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

本基金所持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；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，主要包括利率风险、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	1,714,875.63	-	-	-	1,714,875.63
结算备付金	5,729,713.20	-	-	-	5,729,713.20
存出保证金	-	-	-	428,553.60	428,553.60
交易性金融资产	-	-	-	73,748,097.47	73,748,097.47
应收申购款	-	-	-	171,487.16	171,487.16
资产总计	7,444,588.83	-	-	74,348,138.23	81,792,727.06
负债					
应付赎回款	-	-	-	289,789.42	289,789.42
应付管理人报酬	-	-	-	63,605.80	63,605.80
应付托管费	-	-	-	7,632.67	7,632.67
应付销售服务费	-	-	-	8,711.67	8,711.67
应交税费	-	-	-	18.58	18.58
其他负债	-	-	-	28,251.76	28,251.76
负债总计	-	-	-	398,009.90	398,009.90
利率敏感度缺口	7,444,588.83	-	-	73,950,128.33	81,394,717.16
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	1,147,980.58	-	-	-	1,147,980.58
结算备付金	2,843,207.44	-	-	-	2,843,207.44
交易性金融资产	-	-	-	43,509,986.74	43,509,986.74
应收申购款	-	-	-	119,654.83	119,654.83
资产总计	3,991,188.02	-	-	43,629,641.57	47,620,829.59

负债					
应付赎回款	-	-	-	554,708.02	554,708.02
应付管理人报酬	-	-	-	38,889.06	38,889.06
应付托管费	-	-	-	4,666.69	4,666.69
应付销售服务费	-	-	-	8,249.23	8,249.23
其他负债	-	-	-	53,467.46	53,467.46
负债总计	-	-	-	659,980.46	659,980.46
利率敏感度缺口	3,991,188.02	-	-	42,969,661.11	46,960,849.13

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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中证 500 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%。每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%。在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。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	73,748,097.47	90.61	43,509,986.74	92.65
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	73,748,097.47	90.61	43,509,986.74	92.65

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注 7.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间抵销后的净额为 0。

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%	3,616,579.13	2,057,375.24
	业绩比较基准下降 5%	-3,616,579.13	-2,057,375.24

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	73,748,097.47	43,509,986.74
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	73,748,097.47	43,509,986.74

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	73,748,097.47	90.16
	其中：股票	73,748,097.47	90.16
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	7,444,588.83	9.10
8	其他各项资产	600,040.76	0.73
9	合计	81,792,727.06	100.00

注：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	-	-
B	采矿业	3,498,288.00	4.30
C	制造业	51,581,586.92	63.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,094,848.00	1.35
E	建筑业	401,695.00	0.49
F	批发和零售业	934,682.00	1.15
G	交通运输、仓储和邮政业	1,470,374.00	1.81
H	住宿和餐饮业	30,583.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,329,501.95	4.09
J	金融业	1,640,240.00	2.02
K	房地产业	31,400.00	0.04
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	727,834.00	0.89
N	水利、环境和公共设施管理业	755,302.00	0.93
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	-	-

	乐业		
S	综合	-	-
	合计	65,496,334.87	80.47

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	123,594.00	0.15
B	采矿业	444,191.00	0.55
C	制造业	5,811,525.80	7.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,764.00	0.04
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	156,803.00	0.19
G	交通运输、仓储和邮政业	157,487.00	0.19
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	471,278.58	0.58
J	金融业	438,585.00	0.54
K	房地产业	167,313.00	0.21
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	230,019.00	0.28
N	水利、环境和公共设施管理业	94,970.22	0.12
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	92,593.00	0.11
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	31,639.00	0.04
S	综合	-	-
	合计	8,251,762.60	10.14

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	688347	华虹宏力	3,381	1,137,030.30	1.40
2	002008	大族激光	6,600	990,726.00	1.22
3	300857	协创数据	2,880	978,912.00	1.20
4	300136	信维通信	8,000	954,000.00	1.17
5	300475	香农芯创	3,000	900,000.00	1.11
6	300223	北京君正	3,600	896,040.00	1.10
7	300285	国瓷材料	8,200	846,076.00	1.04
8	002436	兴森科技	15,400	784,630.00	0.96
9	600105	永鼎股份	11,500	776,020.00	0.95
10	688498	源杰科技	394	743,084.00	0.91
11	300567	精测电子	2,200	698,720.00	0.86
12	600498	烽火通信	9,400	691,840.00	0.85
13	301526	国际复材	14,300	667,381.00	0.82
14	688002	睿创微纳	4,306	666,095.14	0.82
15	688469	芯联集成	62,661	664,833.21	0.82
16	002185	华天科技	29,000	646,990.00	0.79
17	001389	广合科技	2,600	616,850.00	0.76
18	002273	水晶光电	17,000	603,160.00	0.74
19	688172	燕东微	7,068	591,308.88	0.73
20	000960	锡业股份	13,700	584,853.00	0.72
21	300604	长川科技	1,700	580,414.00	0.71
22	002738	中矿资源	9,700	572,203.00	0.70
23	688235	百济神州	2,227	567,016.47	0.70
24	001309	德明利	600	565,740.00	0.70
25	002281	光迅科技	2,200	565,268.00	0.69
26	600601	方正科技	40,800	564,672.00	0.69
27	600141	兴发集团	12,000	563,640.00	0.69
28	000831	中国稀土	10,000	554,900.00	0.68
29	600497	驰宏锌锗	44,600	540,106.00	0.66
30	601233	桐昆股份	24,500	530,425.00	0.65
31	600711	盛屯矿业	47,700	523,269.00	0.64
32	600909	华安证券	46,000	511,060.00	0.63
33	000703	恒逸石化	37,500	508,875.00	0.63
34	002821	凯莱英	3,100	502,200.00	0.62
35	688301	奕瑞科技	3,957	490,668.00	0.60
36	688266	泽璟制药	4,097	477,956.02	0.59
37	002155	湖南黄金	20,000	477,400.00	0.59
38	300001	特锐德	12,600	476,658.00	0.59
39	301536	星辰科技	3,700	476,227.00	0.59
40	002487	大金重工	8,200	475,354.00	0.58
41	688220	翱捷科技	3,796	471,918.72	0.58
42	300458	全志科技	11,900	469,574.00	0.58

43	688387	信科移动	23,518	466,597.12	0.57
44	300432	富临精工	23,200	466,088.00	0.57
45	300623	捷捷微电	10,200	458,898.00	0.56
46	000060	中金岭南	60,200	455,714.00	0.56
47	300953	震裕科技	3,400	454,580.00	0.56
48	300454	深信服	4,700	452,140.00	0.56
49	002402	和而泰	17,500	452,025.00	0.56
50	000893	亚钾国际	11,000	449,790.00	0.55
51	002064	华峰化学	47,300	448,877.00	0.55
52	002271	东方雨虹	37,800	448,686.00	0.55
53	002056	横店东磁	14,700	448,056.00	0.55
54	002414	高德红外	33,700	446,862.00	0.55
55	002429	兆驰股份	42,800	444,692.00	0.55
56	300763	锦浪科技	4,900	442,715.00	0.54
57	300073	当升科技	9,200	441,968.00	0.54
58	600699	均胜电子	20,300	438,683.00	0.54
59	002432	九安医疗	6,200	438,216.00	0.54
60	600060	海信视像	15,700	437,559.00	0.54
61	300919	中伟新材	10,000	437,500.00	0.54
62	688120	华海清科	1,355	436,553.90	0.54
63	000733	振华科技	7,700	436,128.00	0.54
64	688343	云天励飞	5,307	433,369.62	0.53
65	000423	东阿阿胶	9,500	430,920.00	0.53
66	600985	淮北矿业	30,500	428,525.00	0.53
67	688187	时代电气	6,166	423,357.56	0.52
68	000728	国元证券	56,500	423,185.00	0.52
69	001203	大中矿业	14,100	422,295.00	0.52
70	688599	天合光能	29,859	421,609.08	0.52
71	688778	厦钨新能	7,726	420,294.40	0.52
72	300679	电连技术	7,000	419,930.00	0.52
73	000519	中兵红箭	19,900	419,293.00	0.52
74	688728	格科微	19,867	418,001.68	0.51
75	601699	潞安环能	29,200	416,976.00	0.51
76	688180	君实生物	12,287	415,546.34	0.51
77	002683	广东宏大	14,100	412,989.00	0.51
78	688772	珠海冠宇	21,029	412,799.27	0.51
79	002266	浙富控股	81,300	411,378.00	0.51
80	603806	福斯特	24,500	411,355.00	0.51
81	000623	吉林敖东	23,200	411,336.00	0.51
82	688568	中科星图	9,915	411,175.05	0.51
83	300002	神州泰岳	52,600	410,806.00	0.50
84	603225	新凤鸣	20,900	410,685.00	0.50
85	600546	山煤国际	37,500	409,875.00	0.50

86	000629	钒钛股份	122,700	409,818.00	0.50
87	600536	中国软件	14,400	404,928.00	0.50
88	601717	中创智领	29,100	404,781.00	0.50
89	001696	宗申动力	19,400	403,714.00	0.50
90	002065	东华软件	56,500	403,410.00	0.50
91	000683	博源化工	70,000	403,200.00	0.50
92	600100	同方股份	58,800	402,780.00	0.49
93	000887	中鼎股份	22,500	402,525.00	0.49
94	603728	鸣志电器	6,600	402,072.00	0.49
95	000032	深桑达 A	16,100	401,695.00	0.49
96	000400	许继电气	18,500	401,450.00	0.49
97	000039	中集集团	49,400	400,634.00	0.49
98	000967	盈峰环境	37,800	398,034.00	0.49
99	000921	海信家电	14,300	390,676.00	0.48
100	600486	扬农化工	7,700	390,390.00	0.48
101	002841	视源股份	11,300	390,189.00	0.48
102	002603	以岭药业	26,000	390,000.00	0.48
103	603486	科沃斯	7,600	385,700.00	0.47
104	000050	深天马 A	38,600	382,526.00	0.47
105	600282	南钢股份	83,300	382,347.00	0.47
106	603885	吉祥航空	37,000	380,730.00	0.47
107	601106	中国一重	114,700	378,510.00	0.47
108	603816	顾家家居	16,900	377,884.00	0.46
109	002120	韵达股份	59,200	376,512.00	0.46
110	003022	联泓新科	14,500	375,550.00	0.46
111	601666	平煤股份	52,500	375,375.00	0.46
112	300676	华大基因	10,700	375,142.00	0.46
113	688166	博瑞医药	10,654	372,996.54	0.46
114	002299	圣农发展	24,600	372,936.00	0.46
115	000883	湖北能源	85,200	368,064.00	0.45
116	000800	一汽解放	61,800	367,710.00	0.45
117	600350	山东高速	32,900	366,177.00	0.45
118	000027	深圳能源	59,000	365,800.00	0.45
119	001286	陕西能源	35,600	360,984.00	0.44
120	300957	贝泰妮	11,400	359,214.00	0.44
121	002423	中粮资本	43,500	358,005.00	0.44
122	688192	迪哲医药	8,935	356,774.55	0.44
123	600295	鄂尔多斯	33,100	354,832.00	0.44
124	600801	华新建材	22,700	354,120.00	0.44
125	003035	南网能源	60,600	352,692.00	0.43
126	688561	奇安信	14,686	352,170.28	0.43
127	000987	越秀资本	44,500	347,990.00	0.43
128	002153	石基信息	48,100	347,763.00	0.43

129	601298	青岛港	43,100	346,955.00	0.43
130	300140	节能环保	69,200	343,924.00	0.42
131	000898	鞍钢股份	181,900	340,153.00	0.42
132	600299	安迪苏	41,700	327,345.00	0.40
133	688361	中科飞测	536	230,480.00	0.28
134	688349	三一重能	12,095	183,602.10	0.23
135	300054	鼎龙股份	1,700	180,149.00	0.22
136	688200	华峰测控	282	148,078.20	0.18
137	300666	江丰电子	400	147,440.00	0.18
138	300757	罗博特科	200	123,800.00	0.15
139	300699	光威复材	4,100	117,465.00	0.14
140	688777	中控技术	968	113,740.00	0.14
141	601869	长飞光纤	200	109,180.00	0.13
142	000021	深科技	1,400	89,978.00	0.11
143	688037	芯源微	200	87,810.00	0.11
144	600435	北方导航	7,500	84,000.00	0.10
145	688019	安集科技	200	67,892.00	0.08
146	002851	麦格米特	400	66,872.00	0.08
147	300373	扬杰科技	300	47,169.00	0.06
148	688629	华丰科技	204	38,252.04	0.05
149	002850	科达利	200	37,860.00	0.05
150	300346	南大光电	400	37,060.00	0.05
151	002138	顺络电子	500	36,550.00	0.04
152	300972	万辰集团	200	34,682.00	0.04
153	002756	永兴材料	600	33,984.00	0.04
154	603345	安井食品	400	32,076.00	0.04
155	688578	艾力斯	292	31,886.40	0.04
156	600499	科达制造	2,300	31,740.00	0.04
157	600988	赤峰黄金	1,200	31,584.00	0.04
158	600595	中孚实业	5,600	31,472.00	0.04
159	600663	陆家嘴	5,000	31,400.00	0.04
160	600754	锦江酒店	1,700	30,583.00	0.04
161	300548	长芯博创	100	27,800.00	0.03
162	002409	雅克科技	100	22,450.00	0.03

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	688012	中微公司	200	93,700.00	0.12
2	300502	新易盛	140	84,980.00	0.10
3	603986	兆易创新	100	81,500.00	0.10
4	688041	海光信息	200	74,060.00	0.09
5	688008	澜起科技	200	61,980.00	0.08

6	688409	富创精密	200	61,250.00	0.08
7	002384	东山精密	200	52,470.00	0.06
8	603061	金海通	100	50,222.00	0.06
9	688396	华润微	482	47,019.10	0.06
10	002463	沪电股份	300	45,840.00	0.06
11	002916	深南电路	100	45,790.00	0.06
12	603186	华正新材	200	45,060.00	0.06
13	688279	峰岬科技	200	44,888.00	0.06
14	688981	中芯国际	273	43,357.86	0.05
15	300661	圣邦股份	300	43,044.00	0.05
16	600584	长电科技	400	41,420.00	0.05
17	688110	东芯股份	200	40,740.00	0.05
18	301165	锐捷网络	500	40,225.00	0.05
19	301678	新恒汇	500	39,420.00	0.05
20	300750	宁德时代	100	39,301.00	0.05
21	002156	通富微电	500	37,935.00	0.05
22	603259	药明康德	300	37,353.00	0.05
23	688372	伟测科技	200	37,200.00	0.05
24	300398	飞凯材料	600	37,050.00	0.05
25	688799	华纳药厂	814	36,524.18	0.04
26	600176	中国巨石	500	36,440.00	0.04
27	600522	中天科技	600	36,408.00	0.04
28	601138	工业富联	500	36,075.00	0.04
29	300568	星源材质	1,900	35,568.00	0.04
30	002475	立讯精密	500	35,200.00	0.04
31	002635	安洁科技	1,700	34,765.00	0.04
32	600183	生益科技	200	34,680.00	0.04
33	000408	藏格矿业	500	34,660.00	0.04
34	300476	胜宏科技	100	34,643.00	0.04
35	002028	思源电气	200	34,600.00	0.04
36	600941	中国移动	400	34,452.00	0.04
37	600309	万华化学	500	34,205.00	0.04
38	002415	海康威视	1,000	34,200.00	0.04
39	688651	盛邦安全	1,057	34,056.54	0.04
40	688378	奥来德	548	33,976.00	0.04
41	603799	华友钴业	700	33,782.00	0.04
42	000100	TCL 科技	5,800	33,756.00	0.04
43	301586	佳力奇	1,000	33,660.00	0.04
44	688589	力合微	1,456	33,458.88	0.04
45	601318	中国平安	700	33,418.00	0.04
46	688113	联测科技	951	33,380.10	0.04
47	300408	三环集团	200	33,380.00	0.04
48	688362	甬矽电子	346	33,354.40	0.04

49	000792	盐湖股份	1,100	33,209.00	0.04
50	600233	圆通速递	2,100	33,075.00	0.04
51	002558	巨人网络	1,200	33,072.00	0.04
52	688021	奥福科技	1,707	33,047.52	0.04
53	301503	智迪科技	1,200	33,012.00	0.04
54	301210	金杨精密	1,100	33,000.00	0.04
55	000426	兴业银锡	1,000	32,960.00	0.04
55	688435	英方软件	1,030	32,960.00	0.04
57	688410	山外山	2,290	32,884.40	0.04
58	600487	亨通光电	300	32,802.00	0.04
59	600482	中国动力	1,000	32,800.00	0.04
60	600460	士兰微	600	32,796.00	0.04
61	601211	国泰海通	1,800	32,760.00	0.04
62	688681	科汇股份	2,342	32,741.16	0.04
63	002460	赣锋锂业	500	32,700.00	0.04
64	601899	紫金矿业	1,300	32,682.00	0.04
65	300698	万马科技	1,200	32,640.00	0.04
66	002745	木林森	2,600	32,630.00	0.04
67	300059	东方财富	1,600	32,608.00	0.04
68	600938	中国海油	1,200	32,580.00	0.04
69	601168	西部矿业	1,200	32,568.00	0.04
70	301487	盟固利	1,700	32,555.00	0.04
71	688548	广钢气体	624	32,510.40	0.04
72	002602	世纪华通	2,300	32,430.00	0.04
73	688255	凯尔达	1,163	32,331.40	0.04
74	000975	山金国际	1,900	32,300.00	0.04
75	301355	南王科技	3,300	32,274.00	0.04
76	000923	河钢资源	2,600	32,266.00	0.04
77	301170	锡南科技	1,500	32,265.00	0.04
78	301082	久盛电气	3,600	32,256.00	0.04
79	003017	大洋生物	1,400	32,200.00	0.04
79	301505	苏州规划	2,000	32,200.00	0.04
81	301131	聚赛龙	1,000	32,130.00	0.04
81	301192	泰祥股份	1,700	32,130.00	0.04
83	300613	富瀚微	400	32,032.00	0.04
84	600188	兖矿能源	1,800	31,986.00	0.04
85	300958	建工修复	3,000	31,920.00	0.04
85	600596	新安股份	2,000	31,920.00	0.04
87	688659	元琛科技	3,057	31,915.08	0.04
88	300713	英可瑞	2,500	31,850.00	0.04
89	003003	天元股份	3,200	31,840.00	0.04
89	300886	华业香料	1,600	31,840.00	0.04
91	002722	物产金轮	2,700	31,833.00	0.04

92	600703	三安光电	1,500	31,830.00	0.04
93	601628	中国人寿	900	31,815.00	0.04
94	000630	铜陵有色	5,000	31,800.00	0.04
94	000933	神火股份	1,500	31,800.00	0.04
96	600900	长江电力	1,200	31,764.00	0.04
97	601898	中煤能源	2,600	31,668.00	0.04
98	600999	招商证券	1,500	31,650.00	0.04
99	600875	东方电气	1,100	31,647.00	0.04
100	002858	力盛体育	2,900	31,639.00	0.04
101	601872	招商轮船	1,800	31,626.00	0.04
102	300929	华骐环保	3,000	31,620.00	0.04
103	002938	鹏鼎控股	300	31,614.00	0.04
104	301456	盘古智能	1,400	31,612.00	0.04
104	600686	金龙汽车	2,800	31,612.00	0.04
106	600030	中信证券	1,100	31,603.00	0.04
107	600029	南方航空	6,100	31,598.00	0.04
108	603993	洛阳钼业	1,800	31,590.00	0.04
109	002780	三夫户外	2,600	31,564.00	0.04
110	002802	洪汇新材	3,000	31,560.00	0.04
111	301515	港通医疗	1,800	31,554.00	0.04
112	601658	邮储银行	6,400	31,552.00	0.04
113	601677	明泰铝业	1,900	31,540.00	0.04
114	603900	莱绅通灵	5,600	31,528.00	0.04
115	603059	倍加洁	1,300	31,525.00	0.04
116	002652	扬子新材	7,400	31,524.00	0.04
117	603901	永创智能	2,900	31,523.00	0.04
118	688092	爱科科技	1,484	31,520.16	0.04
119	688296	和达科技	2,755	31,517.20	0.04
120	000573	粤宏远 A	8,900	31,506.00	0.04
121	002111	威海广泰	3,500	31,500.00	0.04
121	002484	江海股份	300	31,500.00	0.04
121	300793	佳禾智能	2,800	31,500.00	0.04
121	600883	博闻科技	4,500	31,500.00	0.04
125	300424	航新科技	2,000	31,480.00	0.04
126	002873	新天药业	4,300	31,476.00	0.04
127	603626	科森科技	1,700	31,450.00	0.04
128	002388	新亚制程	6,000	31,440.00	0.04
128	002748	世龙实业	3,000	31,440.00	0.04
130	001366	播恩集团	2,900	31,436.00	0.04
131	688701	卓锦股份	4,174	31,430.22	0.04
132	300875	捷强装备	1,100	31,427.00	0.04
133	301335	天元宠物	1,600	31,408.00	0.04
134	001379	腾达科技	2,000	31,400.00	0.04

135	002953	日丰股份	3,600	31,392.00	0.04
135	300137	先河环保	1,800	31,392.00	0.04
137	002295	精艺股份	3,700	31,376.00	0.04
137	002863	今飞凯达	7,400	31,376.00	0.04
139	301006	迈拓股份	2,500	31,375.00	0.04
140	301300	远翔新材	1,000	31,370.00	0.04
141	688528	秦川物联	3,429	31,341.06	0.04
142	301429	森泰股份	2,000	31,340.00	0.04
143	301180	万祥科技	2,500	31,325.00	0.04
144	600858	银座股份	7,100	31,311.00	0.04
145	000985	大庆华科	2,200	31,306.00	0.04
146	002968	新大正	3,700	31,302.00	0.04
147	600778	友好集团	6,400	31,296.00	0.04
148	688616	西力科技	3,097	31,279.70	0.04
149	003016	欣贺股份	5,100	31,263.00	0.04
150	002001	新 和 成	1,100	31,262.00	0.04
151	000725	京东方 A	3,600	31,248.00	0.04
151	600230	沧州大化	2,400	31,248.00	0.04
151	601857	中国石油	3,600	31,248.00	0.04
154	688183	生益电子	236	31,246.40	0.04
155	002535	林州重机	14,200	31,240.00	0.04
156	601600	中国铝业	3,800	31,236.00	0.04
157	601088	中国神华	800	31,232.00	0.04
158	002591	恒大高新	5,100	31,212.00	0.04
159	002016	世荣兆业	7,800	31,200.00	0.04
159	300610	晨化股份	3,200	31,200.00	0.04
161	002760	凤形股份	1,900	31,198.00	0.04
162	601998	中信银行	4,500	31,185.00	0.04
163	002493	荣盛石化	2,900	31,175.00	0.04
164	300220	金运激光	3,000	31,170.00	0.04
165	605567	春雪食品	3,900	31,161.00	0.04
166	603536	惠发食品	4,000	31,160.00	0.04
167	300597	吉大通信	4,400	31,152.00	0.04
167	600444	国机通用	2,400	31,152.00	0.04
169	300851	交大思诺	1,400	31,150.00	0.04
170	301567	贝隆精密	900	31,149.00	0.04
171	601728	中国电信	6,000	31,140.00	0.04
172	600099	林海股份	3,900	31,122.00	0.04
173	002532	天山铝业	2,900	31,117.00	0.04
174	600540	新赛股份	9,400	31,114.00	0.04
175	603041	美思德	3,000	31,110.00	0.04
176	601398	工商银行	4,400	31,108.00	0.04
176	603711	香飘飘	2,800	31,108.00	0.04

178	600697	欧亚集团	3,200	31,104.00	0.04
179	600661	昂立教育	4,500	31,095.00	0.04
180	002820	桂发祥	3,700	31,080.00	0.04
181	300970	华绿生物	1,700	31,076.00	0.04
182	603880	南卫股份	4,400	31,064.00	0.04
183	688565	力源科技	3,285	31,043.25	0.04
184	002659	凯文教育	8,300	31,042.00	0.04
185	603187	海容冷链	2,700	31,023.00	0.04
186	002379	宏桥控股	2,100	31,017.00	0.04
187	000807	云铝股份	1,400	30,996.00	0.04
188	301167	建研设计	2,500	30,975.00	0.04
189	000953	中哲精化	6,000	30,960.00	0.04
189	601218	吉鑫科技	7,200	30,960.00	0.04
191	601288	农业银行	5,100	30,957.00	0.04
192	301010	晶雪节能	1,900	30,951.00	0.04
192	600692	亚通股份	5,700	30,951.00	0.04
194	601688	华泰证券	1,500	30,930.00	0.04
195	600493	凤竹纺织	5,900	30,916.00	0.04
196	300500	启迪设计	3,500	30,905.00	0.04
197	003011	海象新材	1,700	30,889.00	0.04
198	600232	金鹰股份	4,900	30,870.00	0.04
199	601328	交通银行	4,800	30,864.00	0.04
200	001368	通达创智	1,500	30,855.00	0.04
201	688700	东威科技	345	30,843.00	0.04
202	002952	亚世光电	1,400	30,842.00	0.04
203	600137	浪莎股份	1,900	30,837.00	0.04
204	001336	楚环科技	1,400	30,828.00	0.04
205	603506	南都物业	3,300	30,822.00	0.04
206	300675	建科院	2,600	30,810.00	0.04
207	000514	渝开发	8,600	30,788.00	0.04
208	300417	南华仪器	3,000	30,780.00	0.04
209	300987	川网传媒	2,500	30,750.00	0.04
210	000856	冀东装备	4,300	30,745.00	0.04
211	002679	福建金森	3,900	30,732.00	0.04
212	600561	江西长运	6,200	30,690.00	0.04
213	002772	众兴菌业	2,700	30,672.00	0.04
214	300323	华灿光电	1,500	30,600.00	0.04
215	300865	大宏立	1,400	30,590.00	0.04
216	603127	昭衍新药	800	30,576.00	0.04
217	002648	卫星化学	1,300	30,537.00	0.04
218	002144	宏达高科	3,100	30,535.00	0.04
219	002629	仁智股份	7,100	30,530.00	0.04
220	601225	陕西煤业	1,500	30,525.00	0.04

221	600026	中远海能	1,700	30,498.00	0.04
222	600989	宝丰能源	1,500	30,495.00	0.04
223	000526	学大教育	1,200	30,456.00	0.04
224	000949	新乡化纤	4,800	30,432.00	0.04
225	000776	广发证券	1,300	30,420.00	0.04
225	002134	天津普林	1,000	30,420.00	0.04
225	002947	恒铭达	400	30,420.00	0.04
228	600150	中国船舶	900	30,411.00	0.04
229	002855	捷荣技术	3,200	30,400.00	0.04
230	688067	爱威科技	1,508	30,386.20	0.04
231	000333	美的集团	400	30,212.00	0.04
232	688393	安必平	1,699	30,208.22	0.04
233	001373	翔腾新材	1,000	30,150.00	0.04
234	600346	恒力石化	1,700	30,107.00	0.04
235	002128	电投能源	1,300	30,056.00	0.04
236	000338	潍柴动力	1,100	29,975.00	0.04
237	688329	艾隆科技	1,472	29,749.12	0.04
238	605117	德业股份	280	29,730.40	0.04
239	300672	国科微	100	29,500.00	0.04
240	688058	宝兰德	1,403	29,350.76	0.04
241	300940	南极光	1,900	28,652.00	0.04
242	002098	浔兴股份	4,100	26,240.00	0.03
243	301369	联动科技	100	24,500.00	0.03
244	300033	同花顺	100	24,100.00	0.03
245	688390	固德威	219	23,763.69	0.03
246	002188	中天服务	2,500	12,250.00	0.02
247	688682	霍莱沃	228	8,869.20	0.01
248	300414	中光防雷	800	8,816.00	0.01
249	600276	恒瑞医药	100	5,204.00	0.01
250	601995	中金公司	100	3,615.00	0.00
251	603507	振江股份	100	3,289.00	0.00
252	002593	日上集团	300	1,197.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002436	兴森科技	3,035,030.00	6.46
2	000426	兴业银锡	2,614,584.00	5.57
3	300136	信维通信	2,613,150.00	5.56
4	600549	厦门钨业	2,493,781.00	5.31
5	002185	华天科技	2,472,317.00	5.26
6	300454	深信服	2,427,766.00	5.17
7	600060	海信视像	2,359,152.00	5.02

8	688728	格科微	2,318,113.95	4.94
9	600498	烽火通信	2,270,844.00	4.84
10	002738	中矿资源	2,246,389.00	4.78
11	002008	大族激光	2,209,989.00	4.71
12	300012	华测检测	2,182,507.00	4.65
13	600601	方正科技	2,169,882.00	4.62
14	600673	东阳光	2,159,835.00	4.60
15	000423	东阿阿胶	2,156,638.00	4.59
16	601233	桐昆股份	2,155,181.00	4.59
17	000060	中金岭南	2,070,813.00	4.41
18	300567	精测电子	2,063,984.00	4.40
19	002271	东方雨虹	2,027,402.00	4.32
20	603816	顾家家居	1,953,303.10	4.16
21	688235	百济神州	1,940,767.32	4.13
22	600487	亨通光电	1,925,472.00	4.10
23	688777	中控技术	1,924,524.42	4.10
24	002966	苏州银行	1,922,943.00	4.09
25	300207	欣旺达	1,900,783.00	4.05
26	300857	协创数据	1,899,877.00	4.05
27	300285	国瓷材料	1,887,846.00	4.02
28	688281	华秦科技	1,866,020.72	3.97
29	002273	水晶光电	1,865,493.00	3.97
30	002155	湖南黄金	1,825,856.00	3.89
31	300676	华大基因	1,817,631.00	3.87
32	002841	视源股份	1,782,105.84	3.79
33	600486	扬农化工	1,781,464.00	3.79
34	601799	星宇股份	1,769,551.00	3.77
35	688561	奇安信	1,758,245.24	3.74
36	300679	电连技术	1,749,748.00	3.73
37	000683	博源化工	1,724,736.00	3.67
38	300037	新宙邦	1,709,889.00	3.64
39	000887	中鼎股份	1,707,928.00	3.64
40	600517	国网英大	1,703,478.00	3.63
41	601666	平煤股份	1,700,888.00	3.62
42	600096	云天化	1,691,463.00	3.60
43	002064	华峰化学	1,674,774.00	3.57
44	600685	中船防务	1,672,541.00	3.56
45	002430	杭氧股份	1,665,887.00	3.55
46	600754	锦江酒店	1,633,952.00	3.48
47	688172	燕东微	1,632,969.60	3.48
48	300003	乐普医疗	1,628,773.00	3.47
49	600583	海油工程	1,621,402.00	3.45
50	300373	扬杰科技	1,579,812.00	3.36

51	002065	东华软件	1,577,887.00	3.36
52	300001	特锐德	1,553,913.00	3.31
53	688301	奕瑞科技	1,550,826.36	3.30
54	002281	光迅科技	1,549,155.00	3.30
55	603565	中谷物流	1,547,861.00	3.30
56	002926	华西证券	1,539,334.00	3.28
57	603728	鸣志电器	1,537,574.00	3.27
58	688347	华虹宏力	1,523,103.50	3.24
59	002128	电投能源	1,509,304.00	3.21
60	600118	中国卫星	1,505,889.00	3.21
61	002624	完美世界	1,502,266.00	3.20
62	002153	石基信息	1,501,296.00	3.20
63	002432	九安医疗	1,475,315.00	3.14
64	300496	中科创达	1,474,694.00	3.14
65	000960	锡业股份	1,471,480.00	3.13
66	688180	君实生物	1,465,723.44	3.12
67	688220	翱捷科技	1,459,490.13	3.11
68	600378	昊华科技	1,446,569.00	3.08
69	001286	陕西能源	1,441,985.00	3.07
70	000967	盈峰环境	1,440,848.00	3.07
71	600985	淮北矿业	1,440,775.00	3.07
72	000831	中国稀土	1,437,859.00	3.06
73	603920	世运电路	1,436,262.00	3.06
74	000932	华菱钢铁	1,434,610.00	3.05
75	688692	达梦数据	1,433,808.14	3.05
76	002025	航天电器	1,432,498.00	3.05
77	600801	华新建材	1,431,950.00	3.05
78	000021	深科技	1,431,736.00	3.05
79	001389	广合科技	1,429,846.00	3.04
80	300054	鼎龙股份	1,426,719.00	3.04
81	600098	广州发展	1,426,224.00	3.04
82	600141	兴发集团	1,421,164.00	3.03
83	603939	益丰药房	1,406,867.92	3.00
84	300763	锦浪科技	1,405,108.00	2.99
85	600166	福田汽车	1,397,799.00	2.98
86	300623	捷捷微电	1,393,942.00	2.97
87	000893	亚钾国际	1,390,167.00	2.96
88	600998	九州通	1,388,225.00	2.96
89	601699	潞安环能	1,383,061.00	2.95
90	000733	振华科技	1,379,741.00	2.94
91	002558	巨人网络	1,379,216.00	2.94
92	600352	浙江龙盛	1,363,919.00	2.90
93	002402	和而泰	1,363,597.00	2.90

94	601665	齐鲁银行	1,361,098.00	2.90
95	002797	第一创业	1,344,252.00	2.86
96	002532	天山铝业	1,342,082.00	2.86
97	600578	京能电力	1,341,895.00	2.86
98	688475	萤石网络	1,337,722.68	2.85
99	300115	长盈精密	1,332,607.00	2.84
100	000629	钒钛股份	1,331,840.00	2.84
101	000039	中集集团	1,330,462.10	2.83
102	688052	纳芯微	1,328,825.51	2.83
103	000703	恒逸石化	1,328,222.00	2.83
104	002444	巨星科技	1,324,205.00	2.82
105	688114	华大智造	1,318,696.06	2.81
106	600295	鄂尔多斯	1,317,824.00	2.81
107	300146	汤臣倍健	1,313,741.00	2.80
108	002831	裕同科技	1,300,500.00	2.77
109	688385	复旦微电	1,300,408.37	2.77
110	688615	合合信息	1,296,745.21	2.76
111	603228	景旺电子	1,288,555.00	2.74
112	600707	彩虹股份	1,287,963.00	2.74
113	600884	杉杉股份	1,284,057.00	2.73
114	000528	柳 工	1,274,581.00	2.71
115	000830	鲁西化工	1,265,935.00	2.70
116	300919	中伟新材	1,261,277.00	2.69
117	600153	建发股份	1,259,403.00	2.68
118	000739	普洛药业	1,250,733.00	2.66
119	688192	迪哲医药	1,250,719.61	2.66
120	002203	海亮股份	1,242,966.00	2.65
121	002261	拓维信息	1,241,338.00	2.64
122	601997	贵阳银行	1,237,812.00	2.64
123	688772	珠海冠宇	1,237,759.38	2.64
124	300699	光威复材	1,235,307.00	2.63
125	600873	梅花生物	1,235,054.00	2.63
126	000987	越秀资本	1,235,027.00	2.63
127	000415	渤海租赁	1,230,616.00	2.62
128	600764	中国海防	1,230,264.00	2.62
129	002340	格林美	1,226,167.00	2.61
130	603233	大参林	1,224,985.00	2.61
131	002080	中材科技	1,219,131.00	2.60
132	600871	石化油服	1,210,108.00	2.58
133	601106	中国一重	1,205,329.00	2.57
134	688702	盛科通信	1,198,872.08	2.55
135	600143	金发科技	1,192,356.00	2.54
136	603806	福斯特	1,192,065.00	2.54

137	003022	联泓新科	1,190,942.00	2.54
138	000738	航发控制	1,184,521.00	2.52
139	002472	双环传动	1,178,725.00	2.51
140	000933	神火股份	1,172,279.00	2.50
141	688248	南网科技	1,167,467.15	2.49
142	600299	安迪苏	1,166,888.00	2.48
143	002120	韵达股份	1,158,754.00	2.47
144	688375	国博电子	1,157,379.25	2.46
145	688469	芯联集成	1,153,705.43	2.46
146	600131	国网信通	1,136,747.00	2.42
147	002465	海格通信	1,134,902.00	2.42
148	601615	明阳智能	1,131,652.00	2.41
149	601608	中信重工	1,129,700.00	2.41
150	688349	三一重能	1,126,273.75	2.40
151	688213	思特威	1,123,778.65	2.39
152	600536	中国软件	1,110,835.00	2.37
153	300140	节能环保	1,109,185.00	2.36
154	300735	光弘科技	1,103,890.00	2.35
155	002683	广东宏大	1,103,095.00	2.35
156	601061	中信金属	1,100,381.00	2.34
157	601198	东兴证券	1,099,535.00	2.34
158	002821	凯莱英	1,099,053.00	2.34
159	600909	华安证券	1,095,943.00	2.33
160	301358	湖南裕能	1,093,099.00	2.33
161	002299	圣农发展	1,091,589.00	2.32
162	000709	河钢股份	1,089,838.00	2.32
163	600699	均胜电子	1,089,115.00	2.32
164	000783	长江证券	1,086,837.00	2.31
165	601918	新集能源	1,082,625.00	2.31
166	002138	顺络电子	1,072,982.00	2.28
167	000657	中钨高新	1,066,367.00	2.27
168	688266	泽璟制药	1,066,134.93	2.27
169	000598	兴蓉环境	1,063,123.00	2.26
170	605358	立昂微	1,061,318.00	2.26
171	000155	川能动力	1,053,581.00	2.24
172	002223	鱼跃医疗	1,050,573.00	2.24
173	688599	天合光能	1,036,695.73	2.21
174	000921	海信家电	1,029,132.00	2.19
175	301536	星宸科技	1,026,799.00	2.19
176	002078	太阳纸业	1,022,983.00	2.18
177	600499	科达制造	1,017,045.00	2.17
178	603486	科沃斯	1,014,507.00	2.16
179	000729	燕京啤酒	1,013,491.00	2.16

180	002410	广联达	1,011,712.00	2.15
181	600995	南网储能	1,003,070.00	2.14
182	300458	全志科技	1,002,393.00	2.13
183	002156	通富微电	993,013.00	2.11
184	002335	科华数据	990,424.00	2.11
185	002152	广电运通	989,825.00	2.11
186	601717	中创智领	983,793.00	2.09
187	001696	宗申动力	979,347.00	2.09
188	300223	北京君正	979,147.00	2.09
189	002429	兆驰股份	978,743.00	2.08
190	688297	中无人机	972,854.32	2.07
191	000883	湖北能源	972,082.00	2.07
192	000032	深桑达 A	970,682.00	2.07
193	300450	先导智能	967,961.00	2.06
194	603156	养元饮品	953,031.00	2.03
195	600282	南钢股份	952,085.00	2.03
196	002044	美年健康	947,990.00	2.02
197	002756	永兴材料	947,437.00	2.02
198	300604	长川科技	943,510.00	2.01

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	600549	厦门钨业	2,726,780.00	5.81
2	002436	兴森科技	2,686,801.00	5.72
3	600378	昊华科技	2,575,146.00	5.48
4	300012	华测检测	2,505,454.00	5.34
5	688728	格科微	2,444,893.52	5.21
6	600487	亨通光电	2,402,513.00	5.12
7	000426	兴业银锡	2,397,789.00	5.11
8	600517	国网英大	2,394,425.00	5.10
9	002185	华天科技	2,340,180.00	4.98
10	600060	海信视像	2,251,800.00	4.80
11	002966	苏州银行	2,238,746.00	4.77
12	600673	东阳光	2,232,278.36	4.75
13	300373	扬杰科技	2,155,630.00	4.59
14	002008	大族激光	2,088,633.00	4.45
15	600096	云天化	2,082,955.00	4.44
16	000060	中金岭南	2,069,412.00	4.41
17	688702	盛科通信	1,916,174.25	4.08
18	300454	深信服	1,896,323.00	4.04
19	300037	新宙邦	1,894,658.00	4.03
20	601233	桐昆股份	1,891,796.00	4.03

21	002926	华西证券	1,868,564.00	3.98
22	688281	华秦科技	1,865,706.01	3.97
23	300207	欣旺达	1,843,694.00	3.93
24	688235	百济神州	1,814,501.01	3.86
25	688692	达梦数据	1,810,136.03	3.85
26	300567	精测电子	1,807,985.00	3.85
27	688213	思特威	1,765,415.24	3.76
28	688777	中控技术	1,759,676.53	3.75
29	600601	方正科技	1,756,100.00	3.74
30	000021	深科技	1,748,890.00	3.72
31	600166	福田汽车	1,740,897.00	3.71
32	600998	九州通	1,739,906.00	3.71
33	002532	天山铝业	1,736,935.00	3.70
34	601799	星宇股份	1,736,716.00	3.70
35	000423	东阿阿胶	1,723,538.00	3.67
36	688615	合合信息	1,716,624.93	3.66
37	300136	信维通信	1,678,603.00	3.57
38	600707	彩虹股份	1,676,083.00	3.57
39	600884	杉杉股份	1,668,255.00	3.55
40	002430	杭氧股份	1,659,215.00	3.53
41	002738	中矿资源	1,645,647.00	3.50
42	002281	光迅科技	1,629,920.00	3.47
43	300146	汤臣倍健	1,621,727.59	3.45
44	603233	大参林	1,613,425.00	3.44
45	600583	海油工程	1,607,413.00	3.42
46	600685	中船防务	1,595,200.00	3.40
47	600498	烽火通信	1,592,463.00	3.39
48	300003	乐普医疗	1,588,351.00	3.38
49	000783	长江证券	1,581,327.00	3.37
50	300001	特锐德	1,568,569.00	3.34
51	601997	贵阳银行	1,552,909.00	3.31
52	600754	锦江酒店	1,548,969.00	3.30
53	002261	拓维信息	1,531,569.00	3.26
54	603565	中谷物流	1,521,803.00	3.24
55	601918	新集能源	1,520,233.00	3.24
56	002156	通富微电	1,517,123.00	3.23
57	300115	长盈精密	1,509,211.00	3.21
58	002128	电投能源	1,475,354.00	3.14
59	603728	鸣志电器	1,472,233.00	3.14
60	688052	纳芯微	1,465,469.72	3.12
61	000155	川能动力	1,462,713.00	3.11
62	002025	航天电器	1,459,315.00	3.11
63	603816	顾家家居	1,454,652.00	3.10

64	300735	光弘科技	1,450,501.00	3.09
65	600578	京能电力	1,449,851.00	3.09
66	300496	中科创达	1,443,544.00	3.07
67	000739	普洛药业	1,433,618.00	3.05
68	603920	世运电路	1,426,608.00	3.04
69	300679	电连技术	1,424,332.00	3.03
70	002203	海亮股份	1,414,627.00	3.01
71	001286	陕西能源	1,413,031.00	3.01
72	002271	东方雨虹	1,402,650.00	2.99
73	000598	兴蓉环境	1,402,537.00	2.99
74	000683	博源化工	1,397,547.00	2.98
75	002138	顺络电子	1,390,780.00	2.96
76	002841	视源股份	1,385,000.00	2.95
77	002797	第一创业	1,383,994.00	2.95
78	002624	完美世界	1,379,804.00	2.94
79	600098	广州发展	1,377,372.00	2.93
80	002831	裕同科技	1,375,402.00	2.93
81	601665	齐鲁银行	1,373,458.00	2.92
82	300054	鼎龙股份	1,368,653.00	2.91
83	688295	中复神鹰	1,365,707.40	2.91
84	688475	萤石网络	1,351,247.05	2.88
85	300676	华大基因	1,345,079.00	2.86
86	600801	华新建材	1,344,813.00	2.86
87	600118	中国卫星	1,342,113.00	2.86
88	600486	扬农化工	1,341,833.00	2.86
89	601061	中信金属	1,334,563.00	2.84
90	603156	养元饮品	1,332,314.00	2.84
91	300285	国瓷材料	1,327,965.00	2.83
92	688301	奕瑞科技	1,312,386.76	2.79
93	603939	益丰药房	1,300,379.00	2.77
94	688114	华大智造	1,293,633.33	2.75
95	002444	巨星科技	1,282,760.00	2.73
96	000830	鲁西化工	1,280,566.00	2.73
97	603228	景旺电子	1,277,185.00	2.72
98	002335	科华数据	1,275,698.60	2.72
99	688385	复旦微电	1,270,679.76	2.71
100	000887	中鼎股份	1,261,915.00	2.69
101	688561	奇安信	1,256,638.48	2.68
102	000932	华菱钢铁	1,250,910.00	2.66
103	605358	立昂微	1,250,327.00	2.66
104	300857	协创数据	1,238,107.00	2.64
105	002273	水晶光电	1,235,664.00	2.63
106	600153	建发股份	1,233,294.00	2.63

107	600352	浙江龙盛	1,220,024.00	2.60
108	002155	湖南黄金	1,219,603.00	2.60
109	002472	双环传动	1,218,099.00	2.59
110	002340	格林美	1,217,734.00	2.59
111	600435	北方导航	1,216,392.00	2.59
112	002432	九安医疗	1,216,320.00	2.59
113	000528	柳 工	1,215,678.00	2.59
114	300017	网宿科技	1,214,689.00	2.59
115	600873	梅花生物	1,213,092.00	2.58
116	002558	巨人网络	1,201,421.00	2.56
117	300140	节能环保	1,197,857.00	2.55
118	688347	华虹宏力	1,197,406.11	2.55
119	000415	渤海租赁	1,195,586.00	2.55
120	000933	神火股份	1,192,875.00	2.54
121	688172	燕东微	1,182,750.85	2.52
122	002080	中材科技	1,170,950.00	2.49
123	600927	永安期货	1,168,459.00	2.49
124	600764	中国海防	1,168,319.00	2.49
125	601666	平煤股份	1,161,792.00	2.47
126	688248	南网科技	1,151,119.80	2.45
127	603979	金诚信	1,150,140.00	2.45
128	600970	中材国际	1,148,381.00	2.45
129	000738	航发控制	1,145,443.00	2.44
130	301358	湖南裕能	1,144,857.00	2.44
131	001389	广合科技	1,138,937.00	2.43
132	600143	金发科技	1,138,185.00	2.42
133	603049	中策橡胶	1,136,067.00	2.42
134	688183	生益电子	1,134,021.75	2.41
135	002153	石基信息	1,128,873.00	2.40
136	601608	中信重工	1,128,303.00	2.40
137	688375	国博电子	1,121,044.17	2.39
138	002065	东华软件	1,120,775.00	2.39
139	688180	君实生物	1,119,024.98	2.38
140	002064	华峰化学	1,111,368.00	2.37
141	601615	明阳智能	1,095,011.00	2.33
142	000657	中钨高新	1,093,726.00	2.33
143	300699	光威复材	1,090,471.00	2.32
144	600909	华安证券	1,080,654.50	2.30
145	601198	东兴证券	1,068,826.00	2.28
146	600871	石化油服	1,068,550.00	2.28
147	600131	国网信通	1,066,961.00	2.27
148	300623	捷捷微电	1,064,768.00	2.27
149	002223	鱼跃医疗	1,045,623.00	2.23

150	000729	燕京啤酒	1,036,085.00	2.21
151	000709	河钢股份	1,031,448.00	2.20
152	688220	翱捷科技	1,027,335.78	2.19
153	600499	科达制造	1,022,009.00	2.18
154	002465	海格通信	1,015,870.00	2.16
155	600392	盛和资源	1,007,519.00	2.15
156	000967	盈峰环境	1,002,217.00	2.13
157	002078	太阳纸业	994,028.00	2.12
158	002756	永兴材料	992,091.00	2.11
159	688297	中无人机	988,318.15	2.10
160	002152	广电运通	979,169.00	2.09
161	688192	迪哲医药	965,011.40	2.05
162	000733	振华科技	964,413.00	2.05
163	300748	金力永磁	955,994.00	2.04
164	600995	南网储能	951,233.00	2.03
165	601001	晋控煤业	947,656.00	2.02
166	600985	淮北矿业	944,087.00	2.01
167	002410	广联达	941,788.00	2.01
168	601118	海南橡胶	940,153.00	2.00

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	505,066,935.57
卖出股票收入（成交）总额	483,574,047.06

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

本基金为指数增强型基金，投资于标的指数为基础资产的股指期货，旨在灵活调整敞口，配

合日常流动性管理，以更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

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 500 增强截止 2026 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 山东国瓷功能材料股份有限公司因未依法履行其他职责, 涉嫌违反相关法律法规, 关联交易; 于 2025 年 09 月 10 日收到中国证券监督管理委员会山东监管局责令改正, 记入诚信档案的处罚措施。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和视为, 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	428,553.60
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	171,487.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	600,040.76

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

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

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

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
华宝中证 500 增强 A	1,084	28,162.05	20,961,404.24	68.66	9,566,263.37	31.34
华宝中证 500 增强 C	2,307	7,187.86	279,580.63	1.69	16,302,805.19	98.31
合计	3,391	13,892.67	21,240,984.87	45.09	25,869,068.56	54.91

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	华宝中证 500 增强 A	72,204.52	0.2365
	华宝中证 500 增强 C	11,007.59	0.0664
	合计	83,212.11	0.1766

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华宝中证 500 增强 A	0
	华宝中证 500 增强 C	0

	合计	0
本基金基金经理持有 本开放式基金	华宝中证 500 增强 A	0
	华宝中证 500 增强 C	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

无

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华宝中证 500 增强 A	华宝中证 500 增强 C
基金合同生效日 (2018 年 4 月 19 日) 基金份额总额	21,918,920.54	33,238,419.67
本报告期期初基金 份额总额	14,314,612.20	17,522,546.10
本报告期基金总申 购份额	28,525,521.05	20,841,453.61
减：本报告期基金 总赎回份额	12,312,465.64	21,781,613.89
本报告期基金拆分 变动份额	—	—
本报告期期末基金 份额总额	30,527,667.61	16,582,385.82

§ 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、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产和公募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：2024 年 10 月 23 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

本报告期内，未收到关于证券投资基金托管业务受调查或处罚的情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，未收到证券投资基金托管业务相关从业人员受调查或处罚的情况。

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 (%)	
上海证券	4	988,640,982.63	100.00	188,771.91	100.00	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：1. 基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

(1) 选择标准: 资力雄厚，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租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 500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书（更新）	基金管理人网站	2026-01-06
2	华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站	2026-01-06
3	华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站	2026-01-06
4	华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2026-01-22
5	华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理变更公告	基金管理人网站, 中国证券报	2026-01-22
6	华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站	2026-01-23
7	华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站	2026-01-23
8	华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书（更新）	基金管理人网站	2026-01-23
9	华宝基金关于旗下部分基金新增万和证券股份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	2026-01-23
10	华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2025 年年度报告	基金管理人网站	2026-03-31
11	华宝基金关于旗下部分基金新增上海证达通基金销售有限公司为代销机构的通知	基金管理人网站	2026-04-15
12	华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2026-04-22
13	华宝基金关于旗下部分基金新增宁波银行股份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	2026-05-22
14	华宝基金关于旗下部分基金新增东	基金管理人网站, 上海	2026-05-22

	莞证券股份有限公司为代销机构的公告	证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	
15	华宝基金关于旗下部分基金新增中国邮政储蓄银行股份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	2026-06-04
16	华宝基金关于旗下部分基金新增北京加和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	2026-06-05
17	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 (%)
机构	1	20260512~20260630	0.00	20,959,050.85	0.00	20,959,050.85	44.49
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 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同;
- 华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书;
- 华宝中证 500 指数增强型发起式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