华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）（原华宝中证消费龙头指数证券投资基金（LOF）转型）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 03 月 27 日（基金合同生效日）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 6

2.1 基金基本情况（转型后） 6
2.1 基金基本情况（转型前） 6
2.2 基金产品说明（转型后） 7
2.2 基金产品说明（转型前） 8
2.3 基金管理人和基金托管人 8
2.4 信息披露方式 8
2.5 其他相关资料(转型后) 8
2.5 其他相关资料(转型前) 9

§3 主要财务指标和基金净值表现 9

3.1 主要会计数据和财务指标（转型后） 9
3.1 主要会计数据和财务指标(转型前) 10
3.2 基金净值表现（转型后） 11
3.2 基金净值表现（转型前） 13

§4 管理人报告 15

4.1 基金管理人及基金经理情况 15
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 22
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 22
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 22
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 23
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 24
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 24
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 24

§5 托管人报告 24

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 24
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 25
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 25

§6 半年度财务会计报告（未经审计)（转型后） 25

6.1 资产负债表 25
6.2 利润表 26
6.3 净资产变动表 27

6.4 报表附注 29
§6 半年度财务会计报告（未经审计)（转型前） 54
6.1 资产负债表 54
6.2 利润表 56
6.3 净资产变动表 57
6.4 报表附注 59
§7 投资组合报告（转型后） 80
7.1 期末基金资产组合情况 80
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 81
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 81
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 82
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 83
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 83
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 83
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 84
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 84
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 84
7.11 本基金投资股指期货的投资政策 84
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 84
7.13 投资组合报告附注 84
§7 投资组合报告（转型前） 85
7.1 期末基金资产组合情况 85
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 86
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 87
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 89
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 91
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 91
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 91
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 91
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 91
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 91
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 91
7.12 投资组合报告附注 91
§8 基金份额持有人信息（转型后） 92
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 92
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 93
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 93
§8 基金份额持有人信息（转型前） 93
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 93
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 93
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 94

§9 开放式基金份额变动（转型后） 94

§9 开放式基金份额变动（转型前） 94

§10 重大事件揭示 95

10.1 基金份额持有人大会决议 95
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 95
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 95
10.4 基金投资策略的改变 95
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 96
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 96
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(转型后) 96
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(转型前) 97
10.8 其他重大事件（转型后） 98
10.8 其他重大事件（转型前） 100

§11 影响投资者决策的其他重要信息 101

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 101
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 101

§12 备查文件目录 101

12.1 备查文件目录 101
12.2 存放地点 102
12.3 查阅方式 102

§2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）	
基金简称	消费龙头 ETF 联接	
场内简称	消费龙头 LOF	
基金主代码	501090	
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）	
基金合同生效日	2026 年 3 月 27 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	816,477,450.56 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所	
上市日期	2020 年 1 月 6 日	
下属分级基金的基金简称	华宝中证消费龙头 ETF 联接 A	华宝中证消费龙头 ETF 联接 C
下属分级基金的交易代码	501090	009329
报告期末下属分级基金的份额总额	675,285,394.81 份	141,192,055.75 份

2.1.1 目标基金基本情况（转型后）

基金名称	华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	516130
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 9 月 28 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2021 年 10 月 13 日
基金管理人名称	华宝基金管理有限公司
基金托管人名称	中国银行股份有限公司

2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	华宝中证消费龙头指数证券投资基金（LOF）
基金简称	消费龙头 LOF
场内简称	消费龙头 LOF
基金主代码	501090
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2019 年 12 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	792,609,196.01 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所	
上市日期	2020 年 1 月 6 日	
下属分级基金的基金简称	消费龙头 LOF	华宝消费龙头 C
下属分级基金的交易代码	501090	009329
报告期末下属分级基金的份额总额	649,653,128.72 份	142,956,067.29 份

2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	本基金主要通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。正常情况下，本基金力争控制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 4%。
投资策略	本基金为 ETF 联接基金，主要通过投资于目标 ETF 实现对标的指数的紧密跟踪。本基金可以通过申购赎回代理券商以成份股实物形式申购及赎回目标 ETF 基金份额，也可以通过券商在二级市场上买卖目标 ETF 基金份额。本基金将根据开放日申购赎回情况、综合考虑流动性、成本、效率等因素，决定目标 ETF 的投资方式。本基金在二级市场上买卖目标 ETF 基金份额是出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的。
业绩比较基准	中证消费龙头指数收益率×95%＋人民币银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为 ETF 联接基金，目标 ETF 为股票型指数基金，本基金的长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金，并且具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.2.1 目标基金产品说明（转型后）

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。 本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。 对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将通过投资成份股、非成份股、成份股个股衍生品等进行替代。
业绩比较基准	中证消费龙头指数收益率

风险收益特征	本基金为股票型基金,其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金为指数型基金，主要采用组合复制策略，跟踪标的指数，具有与标的指数所表征的市场组合相似的风险收益特征。

2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。正常情况下，本基金力争控制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 4%。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将通过投资成份股、非成份股、成份股个股衍生品等进行替代。
业绩比较基准	中证消费龙头指数收益率×95%＋人民币银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，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	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(转型后)

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、基金管理人	北京市西城区太平桥大街 17 号、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

2.5 其他相关资料(转型前)

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、基金管理人	北京市西城区太平桥大街 17 号、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（转型后）

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2026 年 3 月 27 日（基金合同生效日） - 2026 年 6 月 30 日	
	华宝中证消费龙头 ETF 联接 A	华宝中证消费龙头 ETF 联接 C
本期已实现收益	-93,622,062.39	-20,349,673.31
本期利润	-80,636,308.76	-17,225,649.93
加权平均基金份额本期利润	-0.1217	-0.1204
本期加权平均净值利润率	-11.01%	-11.05%
本期基金份额净值增长率	-10.65%	-10.71%
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	8,511,015.59	-368,191.56
期末可供分配基金份额利润	0.0126	-0.0026
期末基金资产净值	683,796,410.40	140,823,864.19
期末基金份额净值	1.0126	0.9974
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	-10.65%	-10.71%

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。

3.1 主要会计数据和财务指标(转型前)

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 3 月 26 日)	
	消费龙头 LOF	华宝消费龙头 C
本期已实现收益	1,401,489.45	219,269.17
本期利润	-62,153,671.48	-13,963,005.36
加权平均基金份额本期利润	-0.0988	-0.0966
本期加权平均净值利润率	-8.20%	-8.12%
本期基金份额净值增长率	-7.93%	-7.99%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 3 月 26 日)	
期末可供分配利润	86,574,973.74	16,722,162.26
期末可供分配基金份额利润	0.1333	0.1170
期末基金资产净值	736,228,102.46	159,678,229.55
期末基金份额净值	1.1333	1.1170
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 3 月 26 日)	
基金份额累计净值增长率	13.33%	20.99%

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

益。

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

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

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

3.2 基金净值表现（转型后）

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华宝中证消费龙头 ETF 联接 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	-11.00%	0.80%	-13.29%	0.80%	2.29%	0.00%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
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	-10.65%	0.80%	-12.77%	0.80%	2.12%	0.00%

华宝中证消费龙头 ETF 联接 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-11.06%	0.80%	-13.29%	0.80%	2.23%	0.00%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-

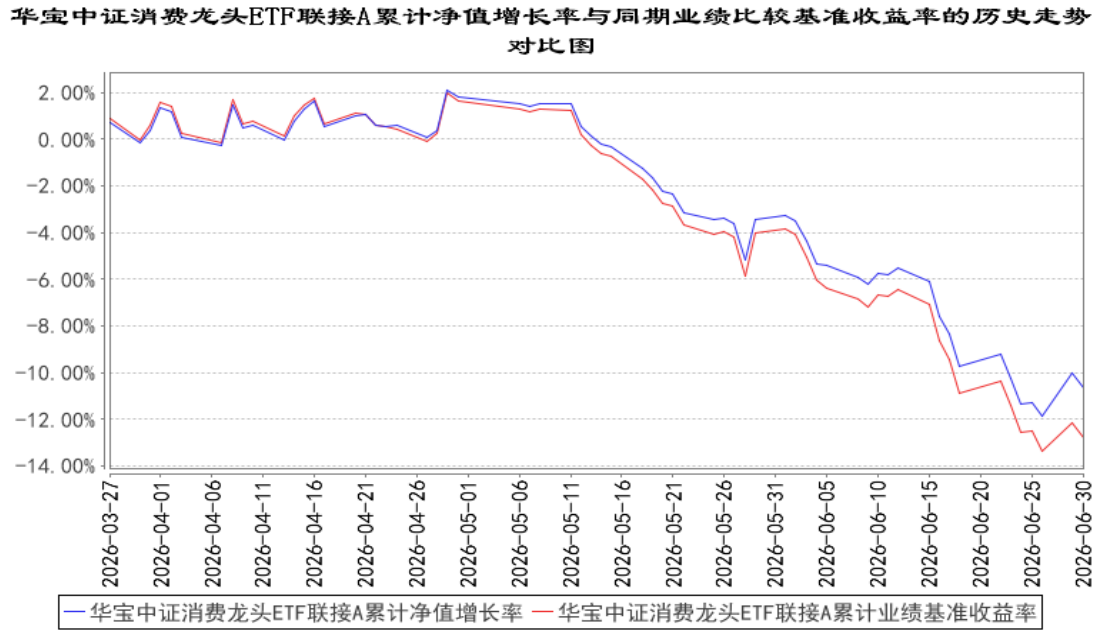
自基金合同生效起至今	-10.71%	0.80%	-12.77%	0.80%	2.06%	0.00%

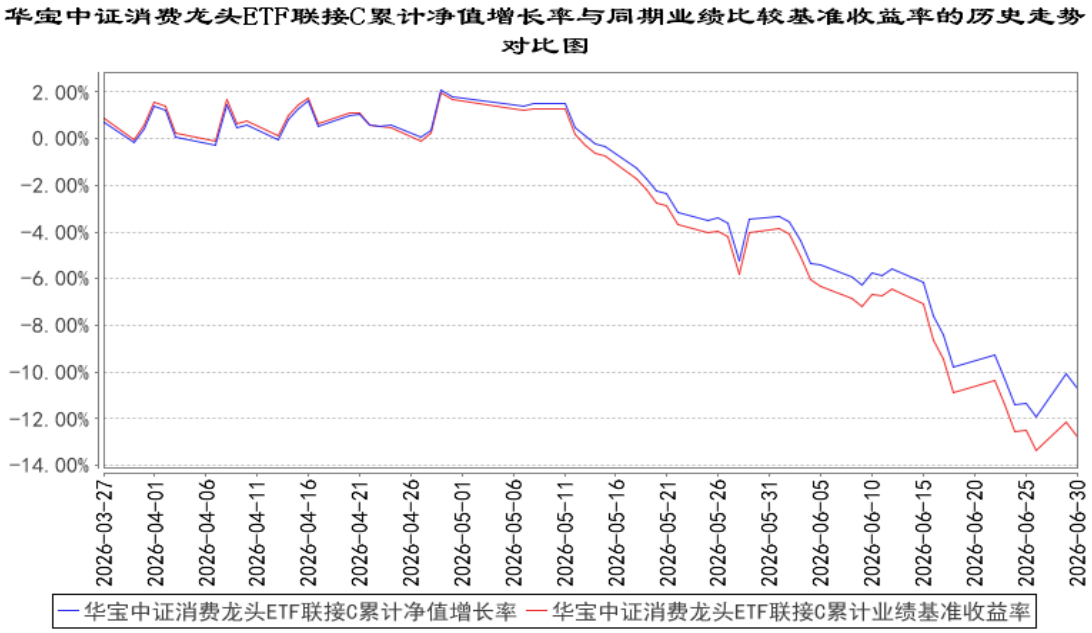
注：（1）本基金自 2026 年 3 月 27 日起，由华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)转型而来，截止报告日本基金基金合同自转型之日起生效未满一年；

（2）基金业绩基准：中证消费龙头指数收益率×95%＋人民币银行活期存款利率（税后）×5%；

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

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





注：1、本基金基金合同生效于 2026 年 03 月 27 日,截止报告日本基金基金合同生效未满一年。

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

3.2 基金净值表现（转型前）

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

消费龙头 LOF

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	-8.32%	0.94%	-8.58%	0.95%	0.26%	-0.01%
过去六个月	-11.50%	0.78%	-12.70%	0.80%	1.20%	-0.02%
过去一年	-7.00%	0.81%	-10.41%	0.83%	3.41%	-0.02%
过去三年	-12.15%	1.07%	-21.36%	1.09%	9.21%	-0.02%
过去五年	-31.41%	1.22%	-43.43%	1.24%	12.02%	-0.02%
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	13.33%	1.31%	-14.90%	1.33%	28.23%	-0.02%

华宝消费龙头 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

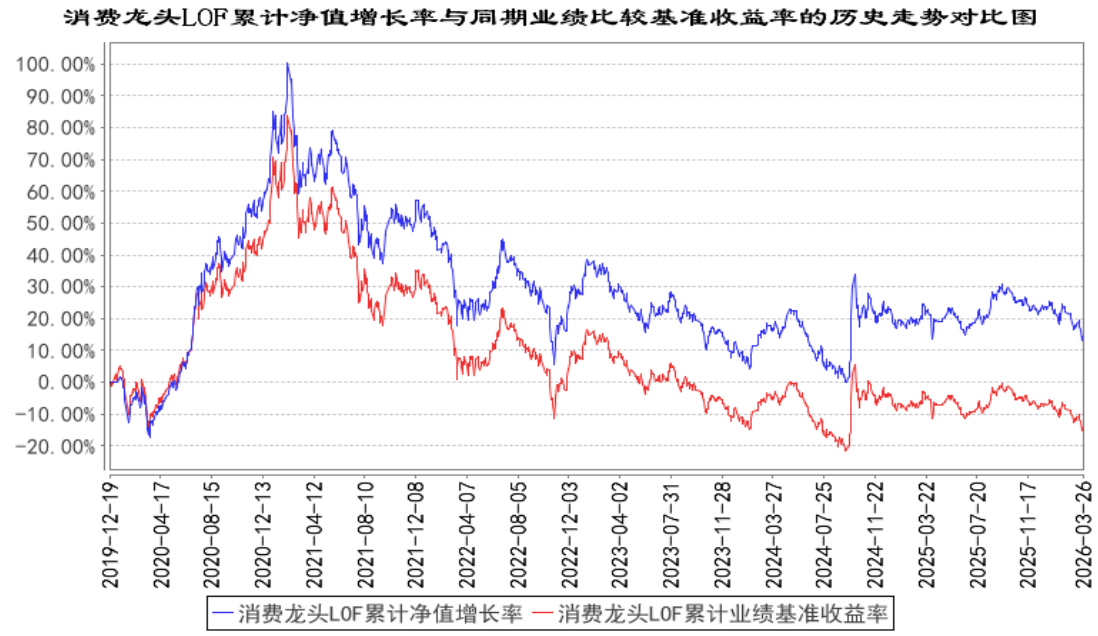
	长率①	长率标准差②	准收益率③	准收益率标准差④		
过去三个月	-8.38%	0.94%	-8.58%	0.95%	0.20%	-0.01%
过去六个月	-11.61%	0.78%	-12.70%	0.80%	1.09%	-0.02%
过去一年	-7.23%	0.81%	-10.41%	0.83%	3.18%	-0.02%
过去三年	-12.82%	1.07%	-21.36%	1.09%	8.54%	-0.02%
过去五年	-32.26%	1.22%	-43.43%	1.24%	11.17%	-0.02%
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	20.99%	1.28%	-10.18%	1.30%	31.17%	-0.02%

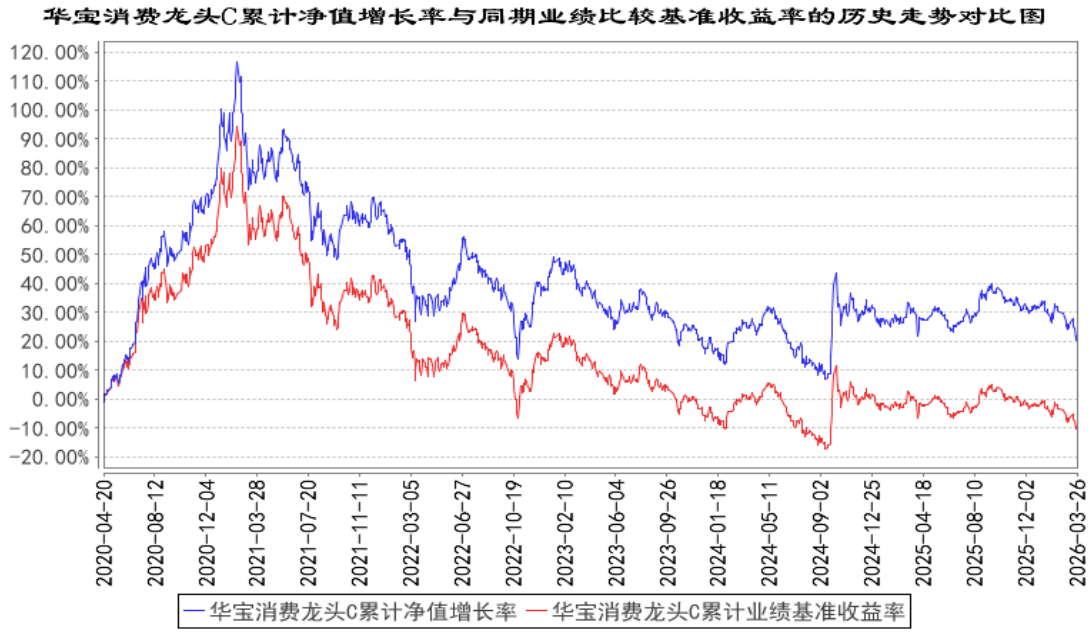
注：（1）本基金成立于 2019 年 12 月 19 日；

（2）基金业绩基准：中证消费龙头指数收益率×95%＋人民币银行活期存款利率（税后）×5%；

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

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





注：

本基金于 2026 年 3 月 27 日转型。

§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（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张放	本基金基金经理	2026-03-27	-	15 年	硕士。曾在海通期货股份有限公司、长江证券股份有限公司从事分析研究工作。2014 年 9 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任投资经理、基金经理助理等职

					务。2021 年 1 月至 2026 年 5 月任华宝中证智能制造主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 3 月至 2023 年 10 月任华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金(LOF)基金经理，2021 年 5 月至 2026 年 2 月任华宝中证大数据产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 9 月至 2026 年 5 月任华宝中证养老产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 10 月至 2024 年 10 月任华宝中证智能制造主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，2021 年 12 月至 2024 年 12 月任华宝国证治理指数型发起式证券投资基金基金经理，2022 年 12 月至 2026 年 5 月任华宝中证绿色能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2023 年 4 月起任华宝中证沪港深新消费指数型证券投资基金基金经理，2023 年 9 月至 2026 年 5 月任华宝中证信息技术应用创新产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2024 年 11 月至 2026 年 3 月任华宝中证 800 红利低波动交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 3 月至 2026 年 3 月任华宝中证 800 红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2025 年 4 月至 2026 年 5 月任华宝国证通用航空产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 5 月起任华宝中证信息技术应用创新产业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，2025 年 6 月起任华宝中证制药交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 8 月起任华宝国证通用航空产业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，2025 年 8 月起任华宝中证制药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，2025 年 9 月起任华宝港股通恒生中国（香港上市）30 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 11 月起任华宝中证港股通信息技术综合交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 12 月起任华宝中证港股通医疗主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2026 年 2 月起任

					华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金、华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2026 年 2 月至 2026 年 3 月任华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)基金经理，2026 年 3 月起任华宝中证港股通信息技术综合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 3 月起任华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金经理，2026 年 4 月起任华宝中证港股通医疗主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
胡洁	本基金基金经理、指数投资总监	2019-12-19	2026-02-12	20 年	硕士。2006 年 6 月加入华宝基金管理有限公司，先后在交易部、产品开发部和量化投资部工作，现任指数投资总监。2012 年 10 月至 2018 年 11 月任华宝上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2012 年 10 月至 2019 年 1 月任上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2015 年 5 月至 2020 年 12 月任华宝中证医疗指数分级证券投资基金基金经理，2015 年 6 月至 2018 年 8 月任华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金经理，2016 年 8 月至 2026 年 2 月任华宝中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2017 年 1 月至 2024 年 10 月任华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金(LOF)基金经理，2017 年 7 月至 2026 年 2 月任华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2018 年 11 月至 2026 年 2 月任华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2019 年 1 月至 2021 年 3 月任华宝标普中国 A 股质量价值指数证券投资

					基金(LOF)基金经理，2019 年 5 月至 2026 年 2 月任华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019 年 7 月至 2026 年 2 月任华宝中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019 年 8 月至 2023 年 10 月任华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金(LOF)基金经理，2019 年 8 月至 2026 年 2 月任华宝中证科技龙头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，2019 年 12 月至 2026 年 2 月任华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)基金经理，2021 年 1 月至 2021 年 5 月任华宝中证医疗指数证券投资基金基金经理，2021 年 3 月至 2026 年 2 月任华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，2021 年 5 月至 2026 年 2 月任华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2021 年 6 月至 2026 年 2 月任华宝中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 8 月至 2026 年 2 月任华宝中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，2021 年 9 月至 2026 年 2 月任华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2023 年 4 月至 2026 年 2 月任华宝中证沪港深新消费指数型证券投资基金基金经理，2023 年 12 月至 2026 年 2 月任华宝标普中国 A 股红利机会交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2024 年 11 月至 2026 年 2 月任华宝标普中国 A 股红利机会交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金经理。
张放	本基金基金经理	2026-02-12	2026-03-26	15 年	硕士。曾在海通期货股份有限公司、长江证券股份有限公司从事分析研究工作。2014 年 9 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任投资经理、基金经理助理等职务。2021 年 1 月至 2026 年 5 月任华宝中证智能制造主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 3 月至 2023 年 10 月任华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金(LOF)基金经理，

					2021 年 5 月至 2026 年 2 月任华宝中证大数据产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 9 月至 2026 年 5 月任华宝中证养老产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 10 月至 2024 年 10 月任华宝中证智能制造主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，2021 年 12 月至 2024 年 12 月任华宝国证治理指数型发起式证券投资基金基金经理，2022 年 12 月至 2026 年 5 月任华宝中证绿色能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2023 年 4 月起任华宝中证沪港深新消费指数型证券投资基金基金经理，2023 年 9 月至 2026 年 5 月任华宝中证信息技术应用创新产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2024 年 11 月至 2026 年 3 月任华宝中证 800 红利低波动交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 3 月至 2026 年 3 月任华宝中证 800 红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2025 年 4 月至 2026 年 5 月任华宝国证通用航空产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 5 月起任华宝中证信息技术应用创新产业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，2025 年 6 月起任华宝中证制药交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 8 月起任华宝国证通用航空产业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，2025 年 8 月起任华宝中证制药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，2025 年 9 月起任华宝港股通恒生中国（香港上市）30 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 11 月起任华宝中证港股通信息技术综合交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 12 月起任华宝中证港股通医疗主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2026 年 2 月起任华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金、华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2026 年 2 月至 2026 年 3 月任华宝

					中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)基金经理，2026 年 3 月起任华宝中证港股通信息技术综合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 3 月起任华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金经理，2026 年 4 月起任华宝中证港股通医疗主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。
张放	本基金的基金经理助理	2019-12-19	2026-02-12	15 年	硕士。曾在海通期货股份有限公司、长江证券股份有限公司从事分析研究工作。2014 年 9 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任投资经理、基金经理助理等职务。2019 年 9 月至 2021 年 3 月任华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金（LOF）基金经理助理，2019 年 10 月至 2020 年 11 月任华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金(LOF)基金经理助理，2019 年 10 月至 2026 年 2 月任华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理，2019 年 12 月至 2026 年 2 月任华宝中证消费龙头指数证券投资基金（LOF）基金经理助理，2020 年 6 月至 2026 年 2 月任华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金、华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理。2021 年 1 月至 2026 年 5 月任华宝中证智能制造主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 3 月至 2023 年 10 月任华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金(LOF)基金经理，2021 年 5 月至 2026 年 2 月任华宝中证大数据产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 9 月至 2026 年 5 月任华宝中证养老产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 10 月至 2024 年 10 月任华宝中证智能制造主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，2021 年 12 月至 2024 年 12 月任华宝国证治理指数型发起式证券投资基金基金经理，2022 年 12 月至 2026 年 5 月任华宝中证绿色能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2023 年 4 月起任华宝中证沪港深新消费指数型证券投资基金基金经理，2023 年 9 月至 2026

					年 5 月任华宝中证信息技术应用创新产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2024 年 11 月至 2026 年 3 月任华宝中证 800 红利低波动交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 3 月至 2026 年 3 月任华宝中证 800 红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2025 年 4 月至 2026 年 5 月任华宝国证通用航空产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 5 月起任华宝中证信息技术应用创新产业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，2025 年 6 月起任华宝中证制药交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 8 月起任华宝国证通用航空产业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，2025 年 8 月起任华宝中证制药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，2025 年 9 月起任华宝港股通恒生中国（香港上市）30 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 11 月起任华宝中证港股通信息技术综合交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 12 月起任华宝中证港股通医疗主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2026 年 2 月起任华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金、华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2026 年 2 月至 2026 年 3 月任华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)基金经理，2026 年 3 月起任华宝中证港股通信息技术综合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 3 月起任华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金经理，2026 年 4 月起任华宝中证港股通医疗主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

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

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

本报告期内，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

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

本报告期内，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）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，中国宏观经济在外部不稳定因素增多、国内供强需弱矛盾仍较突出的背景下，顶住压力运行在合理区间。初步核算，上半年国内生产总值同比增长 4.7%，其中一季度增长 5.0%，二季度增长 4.3%；新质生产力继续较快成长，信息传输、软件和信息技术服务业等新动能行业增

加值增速明显高于整体。宏观政策更加积极有为，财政政策保持必要支出强度；货币政策坚持适度宽松取向，通过总量与结构性工具并用，保持流动性合理充裕，引导资金更多流向科技创新等重点领域，货币金融对实体经济的支持力度总体稳固。海外方面，全球贸易摩擦与关税政策仍扰动供应链与通胀预期；美联储上半年将联邦基金利率目标区间维持在 3.50%—3.75%，并于 6 月议息后释放偏鹰信号、弱化前瞻指引，全球流动性预期由宽松转向观望，外部金融环境不确定性有所上升。指数方面，上半年 A 股呈现显著的结构性分化，科技成长主线领涨、传统板块相对承压，中小盘成长风格整体强于大盘蓝筹。2026 年上半年，以中证 A100 指数和沪深 300 指数为代表的大盘蓝筹股指数分别上涨了 8.47%和 7.55%；而作为中小盘股代表的中证 500 指数和中证 1000 指数分别上涨了 20.97%和 15.99%。2026 年上半年，中证消费龙头指数累计下跌了 20.85%。

本报告期中，本基金从指数证券投资基金变更为 ETF 联接基金。在操作中，我们严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金自转型以来，本报告期基金份额 A 类净值增长率为-10.65%，本报告期基金份额 C 类净值增长率为-10.71%;同期业绩比较基准收益率为-12.77%。

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，展望 2026 年下半年，政策重心有望进一步转向加大逆周期和跨周期调节、持续扩大内需与培育新动能。财政政策方面，超长期特别国债、新型政策性金融工具及地方政府债券有望加快形成实物工作量，继续发挥稳增长、惠民生作用；货币政策端，在坚持适度宽松的同时，更强调前瞻性、灵活性和针对性，总量工具与结构性工具仍有发力空间。“人工智能+”行动与新质生产力产业化将继续成为经济增长的重要支撑，同时品种结构升级等政策有望改善部分行业供给秩序与盈利质量。证券市场方面，经历上半年极致的结构性行情后，市场定价或逐步从主题与流动性驱动更多转向业绩验证；中长期资金入市与居民财富再配置趋势仍在延续，结构性机会有望在景气成长与低估值、高性价比板块之间再平衡。

行业层面，从需求端看，社零增速偏弱，高端白酒动销与渠道库存仍处消化过程。从政策端看，促消费政策由短期刺激向增收提振、场景培育与中长期扩容并重演进，《扩大消费“十五五”规划》锚定居民消费率提升与社零规模扩容目标，叠加城乡居民增收、生育支持及服务消费培育等举措，有望为消费修复提供制度保障。从估值与资金面看，食品饮料等部分消费行业估值回落至历史低位区间，板块股息率提升至较高水平，公募配置比例降至近年低位，中长期资金对高分红、经营质量稳定的消费龙头关注度有所回升。展望后续，消费板块或呈现估值底部支撑与基本

面逐步验证并行的特征，传统消费龙头在股息与业绩兑现下具备修复弹性，情绪价值消费、文娱及新业态构成结构性增量。中证消费龙头指数是在消费行业中选取规模大、经营质量好的 50 只优质龙头公司，覆盖了各消费子行业，具备较好的配置价值，值得投资者关注。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国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“关联方证券出借”、“各关联方投资本基金的情况”、“关联方承销证券”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）（转型后）

6.1 资产负债表

会计主体：华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）

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
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	45,816,507.47
结算备付金		101,929.41
存出保证金		295,255.26
交易性金融资产	6.4.7.2	779,571,792.60
其中：股票投资		6,125,553.44
基金投资		773,446,239.16
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		1,594,145.49
应收股利		-
应收申购款		1,020,558.61
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		828,400,188.84
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026 年 6 月 30 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		3,581,313.06
应付管理人报酬		21,532.01
应付托管费		70,106.91
应付销售服务费		30,690.79
应付投资顾问费		-
应交税费		49.34
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	76,222.14
负债合计		3,779,914.25
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	816,477,450.56
其他综合收益		-
未分配利润	6.4.7.8	8,142,824.03
净资产合计		824,620,274.59
负债和净资产总计		828,400,188.84

注：1.报告截止日 2026 年 06 月 30 日,基金份额总额 816,477,450.56 份，其中华宝中证消费龙头 ETF 联接 A 基金份额总额 675,285,394.81 份，基金份额净值 1.0126 元；华宝中证消费龙头 ETF 联接 C 基金份额总额 141,192,055.75 份，基金份额净值 0.9974 元。

6.2 利润表

会计主体：华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）

本报告期：2026 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

一、营业总收入		-97,393,970.33
1.利息收入		98,221.78
其中：存款利息收入	6.4.7.9	98,221.78
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）		-113,670,121.60
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-112,539,293.29
基金投资收益	6.4.7.11	-425,587.84
债券投资收益	6.4.7.12	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	-705,240.47
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）	6.4.7.17	16,109,777.01
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	68,152.48
减：二、营业总支出		467,988.36
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	92,275.93
其中：暂估管理人报酬		-
2．托管费	6.4.10.2.2	233,792.64
3．销售服务费	6.4.10.2.3	102,505.91
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	6.4.7.19	-
7．税金及附加		10.80
8．其他费用	6.4.7.20	39,403.08
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-97,861,958.69
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-97,861,958.69
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-97,861,958.69

6.3 净资产变动表

会计主体：华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）

本报告期：2026 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 3 月 27 日（基金合同生效日）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	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	792,609,196.01	-	103,297,136.00	895,906,332.01
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	23,868,254.55	-	-95,154,311.97	-71,286,057.42
（一）、综合收益总额	-	-	-97,861,958.69	-97,861,958.69
（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）	23,868,254.55	-	2,707,646.72	26,575,901.27
其中：1.基金申购款	110,428,913.25	-	10,384,255.31	120,813,168.56
2.基金赎回款	-86,560,658.70	-	-7,676,608.59	-94,237,267.29
（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	816,477,450.56	-	8,142,824.03	824,620,274.59

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

向辉　　李孟恒　　张幸骏

基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)（以下简称“本基金”），是由原华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)转型而来。根据本基金的基金管理人华宝基金管理有限公司于 2026 年 3 月 25 日发布的《关于华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)变更为华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）并修订基金合同等法律文件的公告》，自 2026 年 3 月 27 日起华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)转型为本基金，《华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金合同》自该日起生效，《华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)基金合同》于同一日失效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人与注册登记机构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。

本基金为华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“目标 ETF”)的联接基金。目标 ETF 是采用完全复制法实现对中证消费龙头指数紧密跟踪的被动指数基金，本基金主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括：目标 ETF 基金份额、标的指数成份股、备选成份股、国内依法发行上市的其他股票（包括中小板、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）、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）、货币市场工具、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。本基金可以参与融资和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。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%，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，应保持不低于基金资产净值 5%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。

本基金的业绩比较基准为：中证消费龙头指数收益率×95%＋人民币银行活期存款利率（税后）×5%

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 2026 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日止期间的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 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日止期间的的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2026 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种

方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资和基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制

等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的

损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，其中场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行

再投资，场内基金份额持有人只能选择现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交

易所上市或挂牌转让的固定收益品种，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

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

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

(2)　对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红

利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	45,816,507.47
等于：本金	45,807,122.60
加：应计利息	9,384.87
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	45,816,507.47

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		1,364,267.08	-	6,125,553.44	4,761,286.36
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		880,393,054.34	-	773,446,239.16	-106,946,815.18
其他		-	-	-	-
合计		881,757,321.42	-	779,571,792.60	-102,185,528.82

注：基金投资均为本基金持有的目标 ETF 的份额，按目标 ETF 于估值日的份额净值确定公允价值。

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

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	2,182.27
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	647.99
其中：交易所市场	647.99
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	73,391.88

合计	76,222.14

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

华宝中证消费龙头 ETF 联接 A

项目	本期 2026 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	649,653,128.72	649,653,128.72
2026 年 3 月 27 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日基金份额折算调整	-	-
2026 年 3 月 27 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日未领取红利份额折算调整	-	-
2026 年 3 月 27 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日集中申购募集资金本金及利息	-	-
2026 年 3 月 27 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	69,375,220.78	69,375,220.78
本期赎回（以“-”号填列）	-43,742,954.69	-43,742,954.69
本期末	675,285,394.81	675,285,394.81

华宝中证消费龙头 ETF 联接 C

项目	本期 2026 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	142,956,067.29	142,956,067.29
2026 年 3 月 27 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日基金份额折算调整	-	-
2026 年 3 月 27 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日未领取红利份额折算调整	-	-
2026 年 3 月 27 日(基金合同生效日)至 2026	-	-

年 6 月 30 日集中申购募集资金本金及利息		
2026 年 3 月 27 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	41,053,692.47	41,053,692.47
本期赎回（以“-”号填列）	-42,817,704.01	-42,817,704.01
本期末	141,192,055.75	141,192,055.75

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

华宝中证消费龙头 ETF 联接 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	214,287,604.08	-127,712,630.34	86,574,973.74
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	214,287,604.08	-127,712,630.34	86,574,973.74
本期利润	-93,622,062.39	12,985,753.63	-80,636,308.76
本期基金份额交易产生的变动数	4,856,258.49	-2,283,907.88	2,572,350.61
其中：基金申购款	13,010,280.19	-6,148,707.02	6,861,573.17
基金赎回款	-8,154,021.70	3,864,799.14	-4,289,222.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	125,521,800.18	-117,010,784.59	8,511,015.59

华宝中证消费龙头 ETF 联接 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	35,044,414.08	-18,322,251.82	16,722,162.26
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	35,044,414.08	-18,322,251.82	16,722,162.26
本期利润	-20,349,673.31	3,124,023.38	-17,225,649.93
本期基金份额交易产生的变动数	-219,091.26	354,387.37	135,296.11
其中：基金申购款	4,261,772.54	-739,090.40	3,522,682.14
基金赎回款	-4,480,863.80	1,093,477.77	-3,387,386.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,475,649.51	-14,843,841.07	-368,191.56

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期

	2026 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	96,706.38
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	1,116.90
其他	398.50
合计	98,221.78

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3月27日（基金合同生效日）至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-42,178,724.48
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-70,360,568.81
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-112,539,293.29

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 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	426,982,508.00
减：卖出股票成本总额	468,830,600.69
减：交易费用	330,631.79
买卖股票差价收入	-42,178,724.48

6.4.7.10.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年3月27日（基金合同生效日）至2026年6月30日
申购基金份额总额	829,366,900.00
减：现金支付申购款总额	365,096,474.24
减：申购股票成本总额	534,630,994.57
减：交易费用	-
申购差价收入	-70,360,568.81

6.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	5,074,916.30

减：卖出/赎回基金成本总额	5,495,436.21
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	46.06
减：交易费用	5,021.87
基金投资收益	-425,587.84

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 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。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 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。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 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。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 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。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	-705,240.47
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	-705,240.47

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	16,109,777.01
股票投资	123,056,592.19
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-106,946,815.18
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	16,109,777.01

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	29,204.34
基金转换费收入	38,948.14
合计	68,152.48

6.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	7,364.16
信息披露费	31,561.92
证券出借违约金	-
银行费用	467.28
存托服务费	9.72
合计	39,403.08

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
华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金("目标 ETF")	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 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	92,275.93
其中：应支付销售机构的客户维护费	504,579.03
应支付基金管理人的净管理费	-412,303.10

注：对于华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF），基金管理人不得对基金财产中持有的自身管理的基金部分收取管理费，但客户维护费的收取标准并不调减，故净管理费为负。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扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值后的余额的 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扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值后的余额 × 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 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

当期发生的基金应支付的托管费	233,792.64

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金托管费按前一日基金资产净值的 0.1%的年费率计提。其计算公式为：

H=MAX（E×0.1%÷当年天数,0）

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值。

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 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华宝中证消费龙头 ETF 联接 A	华宝中证消费龙头 ETF 联接 C	合计
华宝基金	-	2,527.74	2,527.74
合计	-	2,527.74	2,527.74

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 0.25%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×0.25%÷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

本报告期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 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
民生银行	45,816,507.47	96,706.38

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

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期末本基金持有 1,222,646,600.00 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 80.02%。

除以上情况外，无其他需要说明的关联方交易事项。

6.4.11 利润分配情况

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	57	1,596.00	1,583.46	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
301666	大普	2026 年 4	6 个月	新股	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-

	微	月 8 日		锁定						
301680	固德电材	2026 年 2 月 27 日	6 个月	新股锁定	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301682	宏明电子	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股锁定	69.66	160.06	714	49,737.24	114,282.84	-
301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股锁定	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
603284	林平发展	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股锁定	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股锁定	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603407	长裕集团	2026 年 4 月 29 日	6 个月	新股锁定	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
688759	必贝特	2025 年 10 月 21 日	9 个月	新股锁定	17.78	30.65	12,552	223,174.56	384,718.80	-
688790	昂瑞微	2025 年 12 月 9 日	9 个月	新股锁定	83.06	126.45	2,319	192,616.14	293,237.55	-
688795	摩尔	2025 年 11	9 个月	新股	114.28	676.94	3,199	365,581.72	2,165,531.06	-

	线程	月 26 日		锁定						
688802	沐曦股份	2025 年 12 月 9 日	9 个月	新股锁定	104.66	768.89	2,330	243,857.80	1,791,513.70	-
688808	联讯仪器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新股锁定	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股锁定	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股锁定	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁定	19.68	141.49	1,271	25,013.28	179,833.79	-

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 ETF 联接基金，主要通过投资于目标 ETF 以达到投资目标，属于较高风险品种。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现与跟踪指数相同的风险收益目标。

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款均存放于大型股份制商业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；

在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

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

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，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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金所持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，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	45,816,507.47	-	-	-	45,816,507.47
结算备付金	101,929.41	-	-	-	101,929.41
存出保证金	295,255.26	-	-	-	295,255.26
交易性金融资产	-	-	-	779,571,792.60	779,571,792.60
应收申购款	2,132.56	-	-	1,018,426.05	1,020,558.61
应收清算款	-	-	-	1,594,145.49	1,594,145.49
资产总计	46,215,824.70	-	-	782,184,364.14	828,400,188.84
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,581,313.06	3,581,313.06
应付管理人报酬	-	-	-	21,532.01	21,532.01
应付托管费	-	-	-	70,106.91	70,106.91
应付销售服务费	-	-	-	30,690.79	30,690.79
应交税费	-	-	-	49.34	49.34
其他负债	-	-	-	76,222.14	76,222.14
负债总计	-	-	-	3,779,914.25	3,779,914.25
利率敏感度缺口	46,215,824.70	-	-	778,404,449.89	824,620,274.59

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

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

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交易的目标 ETF 和备选成分股，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。本基金采用被动式指数化投资，主要通过投资目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股达到跟踪指数的目标。本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于该基金资产净值的 90%，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股(首次公开发行或增发等)及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不

高于基金资产净值的 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	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	6,125,553.44	0.74
交易性金融资产－基金投资	773,446,239.16	93.79
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	779,571,792.60	94.54

注：基金投资均为本基金持有的目标 ETF 的份额，按目标 ETF 于估值日的份额净值确定公允价值。

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）
	1.业绩比较基准上升 5%	40,214,690.25
	2.业绩比较基准下降 5%	-40,214,690.25

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
第一层次	773,537,787.51
第二层次	-
第三层次	6,034,005.09
合计	779,571,792.60

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。

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

本基金本报告期末无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）

6.1 资产负债表

会计主体：华宝中证消费龙头指数证券投资基金（LOF）

报告截止日：2026 年 3 月 26 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 3 月 26 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	53,836,482.65	56,264,191.58
结算备付金		139,168.42	83,503.26

存出保证金		301,242.41	258,437.46
交易性金融资产	6.4.7.2	844,400,078.90	876,426,361.36
其中：股票投资		844,400,078.90	876,426,361.36
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		8,813.43	-
应收股利		-	-
应收申购款		2,540,902.04	1,726,563.18
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		901,226,687.85	934,759,056.84
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026 年 3 月 26 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		5.95	1,411,254.19
应付赎回款		4,684,757.16	3,117,035.37
应付管理人报酬		491,838.31	589,759.02
应付托管费		65,578.45	78,634.51
应付销售服务费		29,566.48	38,484.57
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	48,609.49	360,623.95
负债合计		5,320,355.84	5,595,791.61
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	792,609,196.01	756,862,783.48
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	103,297,136.00	172,300,481.75

净资产合计		895,906,332.01	929,163,265.23
负债和净资产总计		901,226,687.85	934,759,056.84

注：1.报告截止日 2026 年 03 月 26 日,基金份额总额 792,609,196.01 份，其中消费龙头 LOF 基金份额总额 649,653,128.72 份，基金份额净值 1.1333 元；华宝消费龙头 C 基金份额总额 142,956,067.29 份，基金份额净值 1.1170 元。

6.2 利润表

会计主体：华宝中证消费龙头指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 3 月 26 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 3 月 26 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		-74,115,612.82	-29,072,693.58
1.利息收入		94,720.51	163,779.90
其中：存款利息收入	6.4.7.9	94,720.51	163,779.90
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）		3,477,146.71	-2,442,640.92
其中：股票投资收益	6.4.7.10	1,656,294.51	-16,037,919.73
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	1,820,852.20	13,595,278.81
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	-77,737,435.46	-26,859,236.86
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	49,955.42	65,404.30

减：二、营业总支出		2,001,064.02	3,506,465.25
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	1,628,158.75	2,807,629.98
其中：暂估管理人报酬		-	-
2．托管费	6.4.10.2.2	217,087.82	374,350.67
3．销售服务费	6.4.10.2.3	100,425.74	203,750.32
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		-	-
8．其他费用	6.4.7.20	55,391.71	120,734.28
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-76,116,676.84	-32,579,158.83
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-76,116,676.84	-32,579,158.83
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-76,116,676.84	-32,579,158.83

6.3 净资产变动表

会计主体：华宝中证消费龙头指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 3 月 26 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 3 月 26 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	756,862,783.48	-	172,300,481.75	929,163,265.23
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	756,862,783.48	-	172,300,481.75	929,163,265.23
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	35,746,412.53	-	-69,003,345.75	-33,256,933.22
（一）、综合收益总额	-	-	-76,116,676.84	-76,116,676.84

（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）	35,746,412.53	-	7,113,331.09	42,859,743.62
其中：1.基金申购款	134,717,649.64	-	26,929,284.11	161,646,933.75
2.基金赎回款	-98,971,237.11	-	-19,815,953.02	-118,787,190.13
（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	792,609,196.01	-	103,297,136.00	895,906,332.01
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	620,003,761.19	-	137,027,405.44	757,031,166.63
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	620,003,761.19	-	137,027,405.44	757,031,166.63
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	28,445,312.36	-	-26,933,483.60	1,511,828.76
（一）、综合收益总额	-	-	-32,579,158.83	-32,579,158.83
（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	28,445,312.36	-	5,645,675.23	34,090,987.59

列）				
其中：1.基金申购款	179,043,314.14	-	34,093,158.75	213,136,472.89
2. 基金赎回款	-150,598,001.78	-	-28,447,483.52	-179,045,485.30
（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	648,449,073.55	-	110,093,921.84	758,542,995.39

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

向辉	李孟恒	张幸骏
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华宝中证消费龙头指数证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2019]654 号文《关于准予华宝中证消费龙头指数证券投资基金（LOF）注册的批复》准予注册，由华宝基金管理有限公司于 2019 年 10 月 8 日至 2019 年 12 月 16 日止期间向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2019）验字第 61471289_B06 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2019 年 12 月 19 日生效。本基金为契约型、上市开放式（LOF），存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 288,441,220.43 元；在募集期间产生利息为人民币 139,566.41 元。以上实收基金合计为人民币 288,580,786.84 元，折合 288,580,786.84 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 2020 年 4 月 16 日发布的《华宝基金管理有限公司关于华宝中证消费龙头指数证券投资基金（LOF）增加 C 类份额并修改基金合同的公告》，从 2020 年 4 月 17 日起，本基金增设 C 类基

金份额（以下简称“华宝消费龙头 C”），原有份额为 A 类基金份额（以下简称“华宝消费龙头 LOF”）。其中，华宝消费龙头 LOF 是指在投资者申购时收取申购费且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额；华宝消费龙头 C 是指在投资者申购时不收取申购费但从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额。

根据本基金的基金管理人华宝基金管理有限公司于 2026 年 3 月 25 日发布的《关于华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)变更为华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）并修订基金合同等法律文件的公告》，自 2026 年 3 月 27 日起本基金转型为华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及《华宝中证消费龙头指数证券投资基金（LOF）招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围包括标的指数成份股、备选成份股、国内依法发行上市的其他股票（包括中小板、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）、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）、货币市场工具、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。本基金可以参与融资和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。

基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，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，应保持不低于基金资产净值 5%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。

本基金的业绩比较基准为：中证消费龙头指数收益率×95%＋人民币银行活期存款利率（税后）×5%。

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 3 月 26 日（基金合同失效前日）的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 3 月 26 日（基金合同失效前日）止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

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

2027 年 12 月 31 日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对

在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 3 月 26 日
活期存款	53,836,482.65
等于：本金	53,830,066.35
加：应计利息	6,416.30
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	53,836,482.65

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 3 月 26 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		962,695,384.73	-	844,400,078.90	-118,295,305.83
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		962,695,384.73	-	844,400,078.90	-118,295,305.83

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

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 3 月 26 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	5,114.77
应付证券出借违约金	-

应付交易费用	9,028.92
其中：交易所市场	9,028.92
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	34,465.80
合计	48,609.49

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

消费龙头 LOF

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 3 月 26 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	610,130,518.32	610,130,518.32
本期申购	78,823,706.83	78,823,706.83
本期赎回（以“-”号填列）	-39,301,096.43	-39,301,096.43
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	649,653,128.72	649,653,128.72

华宝消费龙头 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 3 月 26 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	146,732,265.16	146,732,265.16
本期申购	55,893,942.81	55,893,942.81
本期赎回（以“-”号填列）	-59,670,140.68	-59,670,140.68
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	142,956,067.29	142,956,067.29

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

消费龙头 LOF

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	199,869,691.87	-58,963,708.71	140,905,983.16
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	199,869,691.87	-58,963,708.71	140,905,983.16

本期利润	1,401,489.45	-63,555,160.93	-62,153,671.48
本期基金份额交易产生的变动数	13,016,422.76	-5,193,760.70	7,822,662.06
其中：基金申购款	25,945,375.59	-9,869,149.43	16,076,226.16
基金赎回款	-12,928,952.83	4,675,388.73	-8,253,564.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	214,287,604.08	-127,712,630.34	86,574,973.74

华宝消费龙头 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	35,744,251.72	-4,349,753.13	31,394,498.59
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	35,744,251.72	-4,349,753.13	31,394,498.59
本期利润	219,269.17	-14,182,274.53	-13,963,005.36
本期基金份额交易产生的变动数	-919,106.81	209,775.84	-709,330.97
其中：基金申购款	13,682,303.60	-2,829,245.65	10,853,057.95
基金赎回款	-14,601,410.41	3,039,021.49	-11,562,388.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	35,044,414.08	-18,322,251.82	16,722,162.26

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 3 月 26 日
活期存款利息收入	93,766.32
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	391.62
其他	562.57
合计	94,720.51

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 3 月 26 日
卖出股票成交总额	2,600,997.49
减：卖出股票成本总额	931,268.46
减：交易费用	13,434.52
买卖股票差价收入	1,656,294.51

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

6.4.7.13.1 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 3 月 26 日
股票投资产生的股利收益	1,820,852.20
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,820,852.20

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 3 月 26 日
1.交易性金融资产	-77,737,435.46
股票投资	-77,737,435.46
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2.衍生工具	-
权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-77,737,435.46

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 3 月 26 日
基金赎回费收入	46,672.42
基金转换费收入	3,283.00
合计	49,955.42

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 3 月 26 日
审计费用	6,520.35
信息披露费	27,945.45
证券出借违约金	-
公证费	10,000.00
银行费用	434.69
存托服务费	491.22
律师费	10,000.00
合计	55,391.71

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 3 月 26 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	1,628,158.75	2,807,629.98
其中：应支付销售机构的客户维护费	701,953.06	1,079,187.99
应支付基金管理人的净管理费	926,205.69	1,728,441.99

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的 0.75%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值× 0.75%/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 3 月 26 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	217,087.82	374,350.67

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金托管费按前一日基金资产净值的 0.1%的年费率计提。其计算公式为：

H=MAX（E×0.1%÷当年天数,0）

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值。

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	本期

方名称	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 3 月 26 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	消费龙头 LOF	华宝消费龙头 C	合计
华宝基金	-	2,360.78	2,360.78
合计	-	2,360.78	2,360.78
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		
	消费龙头 LOF	华宝消费龙头 C	合计
华宝基金	-	6,038.54	6,038.54
华宝证券	-	17.96	17.96
合计	-	6,056.50	6,056.50

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 0.25%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×0.25%÷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

本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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 3 月 26 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	53,836,482.65	93,766.32	46,123,734.62	163,308.94

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

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 3 月 26 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	32.83	57	1,596.00	1,871.31	-
001233	海安集团	2025 年 11 月 18 日	6 个月	新股锁定	48.00	60.87	370	17,760.00	22,521.90	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定	7.82	7.82	1,743	13,630.26	13,630.26	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	1 个月内（含）	新股流通受	7.82	7.82	4,064	31,780.48	31,780.48	-

				限						
001280	中国铀业	2025 年 11 月 25 日	6 个月	新股锁定	17.89	72.44	2,277	40,735.53	164,945.88	-
001285	瑞立科密	2025 年 9 月 23 日	6 个月	新股锁定	42.28	50.17	137	5,792.36	6,873.29	-
001369	双欣材料	2025 年 12 月 23 日	6 个月	新股锁定	6.85	12.21	897	6,144.45	10,952.37	-
001386	马可波罗	2025 年 10 月 15 日	6 个月	新股锁定	13.75	19.70	1,626	22,357.50	32,032.20	-
301449	天溯计量	2025 年 12 月 16 日	6 个月	新股锁定	36.80	71.10	112	4,121.60	7,963.20	-
301563	云汉芯城	2025 年 9 月 23 日	6 个月	新股锁定	27.00	146.60	110	2,970.00	16,126.00	-
301638	南网数字	2025 年 11 月 11 日	6 个月	新股锁定	5.69	25.56	2,322	13,212.18	59,350.32	-
301667	纳百川	2025 年 12 月 10 日	6 个月	新股锁定	22.63	83.03	151	3,417.13	12,537.53	-
301680	固德电材	2026 年 2 月 27 日	6 个月	新股锁定	58.00	91.09	117	6,786.00	10,657.53	-
301682	宏明电子	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股锁定	69.66	113.00	714	49,737.24	80,682.00	-
301683	慧谷新	2026 年 3 月 24	6 个月	新股锁	78.38	78.38	96	7,524.48	7,524.48	-

	材	日		定						
301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	1 个月内（含）	新股流通受限	78.38	78.38	856	67,093.28	67,093.28	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股锁定	21.93	42.53	195	4,276.35	8,293.35	-
601026	道生天合	2025 年 10 月 9 日	6 个月	新股锁定	5.98	19.17	451	2,696.98	8,645.67	-
603092	德力佳	2025 年 10 月 30 日	6 个月	新股锁定	46.68	65.04	146	6,815.28	9,495.84	-
603175	超颖电子	2025 年 10 月 17 日	6 个月	新股锁定	17.08	81.36	169	2,886.52	13,749.84	-
603248	锡华科技	2025 年 12 月 16 日	6 个月	新股锁定	10.10	24.68	260	2,626.00	6,416.80	-
603284	林平发展	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股锁定	37.88	40.15	46	1,742.48	1,846.90	-
603334	丰倍生物	2025 年 10 月 29 日	6 个月	新股锁定	24.49	50.18	88	2,155.12	4,415.84	-
688759	必贝特	2025 年 10 月 21 日	9 个月	新股锁定	17.78	31.76	12,552	223,174.56	398,651.52	-
688790	昂瑞微	2025 年 12 月 9 日	9 个月	新股锁定	83.06	104.76	2,319	192,616.14	242,938.44	-
688795	摩	2025	9 个月	新	114.28	394.51	3,199	365,581.72	1,262,037.49	-

	尔线程	年 11 月 26 日		股锁定						
688796	百奥赛图	2025 年 12 月 2 日	6 个月	新股锁定	26.68	76.09	423	11,285.64	32,186.07	-
688802	沐曦股份	2025 年 12 月 9 日	9 个月	新股锁定	104.66	415.92	2,330	243,857.80	969,093.60	-
688807	优迅股份	2025 年 12 月 10 日	6 个月	新股锁定	51.66	194.67	131	6,767.46	25,501.77	-
688809	强一股份	2025 年 12 月 23 日	6 个月	新股锁定	85.09	245.30	259	22,038.31	63,532.70	-
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	1 个月内（含）	新股流通受限	26.28	26.28	2,103	55,266.84	55,266.84	-
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定	26.28	26.28	234	6,149.52	6,149.52	-
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股锁定	55.95	55.44	177	9,903.15	9,812.88	-
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股锁定	9.47	43.46	1,717	16,259.99	74,620.82	-

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

本基金为指数型基金，采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，跟踪中证消费龙头指数。本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现与跟踪指数相同的风险收益目标。

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

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法是通过结合定性分析和定量分析方法，估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具的特

征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定相应置信程度和风险损失的限度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款均存放于大型股份制商业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于本报告期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金净资产的比例较低（含债券投资比例为零），因此无重大信用风险(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，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。（上年度末：同）

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金所持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，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、结算备付金和存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 3 月 26 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	53,836,482.65	-	-	-	53,836,482.65
结算备付金	139,168.42	-	-	-	139,168.42
存出保证金	301,242.41	-	-	-	301,242.41
交易性金融资产	-	-	-	844,400,078.90	844,400,078.90
应收申购款	2,202.55	-	-	2,538,699.49	2,540,902.04
应收清算款	-	-	-	8,813.43	8,813.43
资产总计	54,279,096.03	-	-	846,947,591.82	901,226,687.85
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,684,757.16	4,684,757.16
应付管理人报酬	-	-	-	491,838.31	491,838.31
应付托管费	-	-	-	65,578.45	65,578.45
应付清算款	-	-	-	5.95	5.95
应付销售服务费	-	-	-	29,566.48	29,566.48
其他负债	-	-	-	48,609.49	48,609.49
负债总计	-	-	-	5,320,355.84	5,320,355.84
利率敏感度缺口	54,279,096.03	-	-	841,627,235.98	895,906,332.01
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	56,264,191.58	-	-	-	56,264,191.58
结算备付金	83,503.26	-	-	-	83,503.26
存出保证金	258,437.46	-	-	-	258,437.46
交易性金融资产	-	-	-	876,426,361.36	876,426,361.36
应收申购款	4,691.84	-	-	1,721,871.34	1,726,563.18
资产总计	56,610,824.14	-	-	878,148,232.70	934,759,056.84
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,117,035.37	3,117,035.37
应付管理人报酬	-	-	-	589,759.02	589,759.02
应付托管费	-	-	-	78,634.51	78,634.51
应付清算款	-	-	-	1,411,254.19	1,411,254.19
应付销售服务费	-	-	-	38,484.57	38,484.57

其他负债	-	-	-	360,623.95	360,623.95
负债总计	-	-	-	5,595,791.61	5,595,791.61
利率敏感度缺口	56,610,824.14	-	-	872,552,441.09	929,163,265.23

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券银行间同业市场交易的债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标，股票资产跟踪的标的指数为中证消费龙头指数。本基金持有股票的比例不低于基金资产的 90%，投资于中证消费龙头指数成份股及其备选成份股的市值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 3 月 26 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	844,400,078.90	94.25	876,426,361.36	94.32
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	844,400,078.90	94.25	876,426,361.36	94.32

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 3 月 26 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	1.业绩比较基准上升 5%	43,731,815.25	45,263,507.83
	2.业绩比较基准下降 5%	-43,731,815.25	-45,263,507.83

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 3 月 26 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	840,660,880.98	872,216,983.12
第二层次	181,444.86	-
第三层次	3,557,753.06	4,209,378.24
合计	844,400,078.90	876,426,361.36

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。

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（转型后）

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	6,125,553.44	0.74
	其中：股票	6,125,553.44	0.74
2	基金投资	773,446,239.16	93.37
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	45,918,436.88	5.54
8	其他各项资产	2,909,959.36	0.35
9	合计	828,400,188.84	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 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	36,149.82	0.00
C	制造业	6,085,295.79	0.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,583.46	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,524.37	0.00
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	6,125,553.44	0.74

7.2.2 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688795	摩尔线程	3,199	2,165,531.06	0.26
2	688802	沐曦股份	2,330	1,791,513.70	0.22
3	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.07
4	688759	必贝特	12,552	384,718.80	0.05
5	688790	昂瑞微	2,319	293,237.55	0.04
6	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.03
7	688820	盛合晶微	1,271	179,833.79	0.02
8	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.01
9	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.01

10	600519	贵州茅台	57	67,572.93	0.01
11	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
12	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
13	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
14	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
15	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
16	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
17	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
18	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
19	601799	星宇股份	68	6,162.16	0.00
20	603605	珀莱雅	91	5,452.72	0.00
21	688169	石头科技	48	4,558.56	0.00
22	603596	伯特利	118	2,931.12	0.00
23	601888	中国中免	47	2,524.37	0.00
24	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
25	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
26	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
27	603049	中策橡胶	33	1,478.73	0.00
28	603288	海天味业	14	464.24	0.00
29	600660	福耀玻璃	8	403.52	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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	24,256,045.00	2.94
2	603202	天有为	6,535,640.84	0.79
3	603049	中策橡胶	3,890,962.00	0.47
4	603486	科沃斯	1,676,599.00	0.20
5	603605	珀莱雅	1,547,361.00	0.19
6	600729	重百集团	699,450.00	0.08
7	689009	九号公司	575,086.33	0.07
8	603195	公牛集团	508,798.34	0.06
9	600887	伊利股份	425,565.00	0.05
10	688820	盛合晶微	249,975.36	0.03
11	600660	福耀玻璃	231,478.00	0.03
12	600690	海尔智家	210,109.00	0.03
13	601888	中国中免	174,558.00	0.02
14	603288	海天味业	165,827.00	0.02
15	601127	赛力斯	147,885.00	0.02
16	301666	大普微	140,451.84	0.02
17	688808	联讯仪器	132,973.12	0.02
18	600809	山西汾酒	118,187.00	0.01
19	601058	赛轮轮胎	83,728.00	0.01

20	600873	梅花生物	56,136.00	0.01

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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	000333	美的集团	125,456,403.55	15.21
2	000651	格力电器	64,074,454.39	7.77
3	002714	牧原股份	46,363,662.49	5.62
4	300498	温氏股份	34,055,213.12	4.13
5	002027	分众传媒	24,571,989.56	2.98
6	002920	德赛西威	11,850,179.00	1.44
7	600809	山西汾酒	10,418,612.87	1.26
8	688169	石头科技	9,539,725.85	1.16
9	002472	双环传动	9,325,662.00	1.13
10	300251	光线传媒	8,281,105.00	1.00
11	601127	赛力斯	7,601,171.00	0.92
12	601799	星宇股份	6,614,841.00	0.80
13	300972	万辰集团	6,542,211.00	0.79
14	000887	中鼎股份	5,409,212.00	0.66
15	300144	宋城演艺	4,613,322.00	0.56
16	002508	老板电器	3,552,719.00	0.43
17	600690	海尔智家	2,977,505.99	0.36
18	300979	华利集团	2,877,211.00	0.35
19	600887	伊利股份	2,875,428.00	0.35
20	002003	伟星股份	2,598,602.00	0.32

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	42,130,477.61
卖出股票收入（成交）总额	426,982,508.00

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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金	指数基金	交易型开放式	华宝基金管理有限公司	773,446,239.16	93.79

7.11 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.12.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

7.12.2 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

7.13.2 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。

7.13.3 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	295,255.26
2	应收清算款	1,594,145.49
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	1,020,558.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,909,959.36

7.13.4 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。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688795	摩尔线程	2,165,531.06	0.26	新股锁定
2	688802	沐曦股份	1,791,513.70	0.22	新股锁定
3	301666	大普微	565,262.60	0.07	新股锁定
4	688759	必贝特	384,718.80	0.05	新股锁定
5	688790	昂瑞微	293,237.55	0.04	新股锁定
6	688808	联讯仪器	258,245.79	0.03	新股锁定
7	688820	盛合晶微	179,833.79	0.02	新股锁定
8	688818	电科蓝天	120,430.38	0.01	新股锁定
9	301682	宏明电子	114,282.84	0.01	新股锁定

7.13.6 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。

§7 投资组合报告（转型前）

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	844,400,078.90	93.69
	其中：股票	844,400,078.90	93.69
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	53,975,651.07	5.99

8	其他各项资产	2,850,957.88	0.32
9	合计	901,226,687.85	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	83,253,648.00	9.29
B	采矿业	-	-
C	制造业	669,992,377.55	74.78
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	10,324,483.00	1.15
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	4,052,800.00	0.45
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,128,590.00	0.24
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	50,624,530.43	5.65
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	1,725,570.00	0.19
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	18,558,882.00	2.07
S	综合	-	-
	合计	840,660,880.98	93.83

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	210,356.62	0.02

C	制造业	3,411,344.40	0.38
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	16,126.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	1,871.31	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	59,350.32	0.01
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	40,149.27	0.00
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	3,739,197.92	0.42

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	600519	贵州茅台	97,857	137,115,271.26	15.30
2	000333	美的集团	1,695,759	126,028,808.88	14.07
3	000651	格力电器	1,694,058	64,272,560.52	7.17
4	600887	伊利股份	2,391,300	62,054,235.00	6.93
5	002714	牧原股份	1,032,600	45,434,400.00	5.07
6	600660	福耀玻璃	605,808	34,319,023.20	3.83
7	300498	温氏股份	2,012,400	33,566,832.00	3.75
8	600690	海尔智家	1,418,400	32,779,224.00	3.66
9	601127	赛力斯	308,700	29,017,800.00	3.24
10	600809	山西汾酒	184,500	27,269,100.00	3.04

11	601888	中国中免	369,047	26,087,932.43	2.91
12	002027	分众传媒	3,821,900	24,536,598.00	2.74
13	603288	海天味业	630,614	23,301,187.30	2.60
14	601058	赛轮轮胎	994,400	13,086,304.00	1.46
15	002920	德赛西威	112,800	11,868,816.00	1.32
16	689009	九号公司	217,027	10,080,904.15	1.13
17	688169	石头科技	78,363	9,599,467.50	1.07
18	002472	双环传动	256,900	9,317,763.00	1.04
19	600873	梅花生物	742,100	8,519,308.00	0.95
20	300251	光线传媒	554,500	8,212,145.00	0.92
21	603596	伯特利	160,480	7,168,641.60	0.80
22	601799	星宇股份	53,968	6,576,540.48	0.73
23	300972	万辰集团	35,700	6,557,019.00	0.73
24	600398	海澜之家	907,800	5,592,048.00	0.62
25	603605	珀莱雅	89,791	5,467,373.99	0.61
26	000887	中鼎股份	298,600	5,437,506.00	0.61
27	603486	科沃斯	87,600	5,333,088.00	0.60
28	300144	宋城演艺	595,300	4,589,763.00	0.51
29	600872	中炬高新	235,400	4,277,218.00	0.48
30	600598	北大荒	268,800	4,252,416.00	0.47
31	603195	公牛集团	102,548	4,228,054.04	0.47
32	600258	首旅酒店	253,300	4,052,800.00	0.45
33	002508	老板电器	178,600	3,548,782.00	0.40
34	600933	爱柯迪	194,700	3,290,430.00	0.37
35	601098	中南传媒	271,600	2,960,440.00	0.33
36	300979	华利集团	66,200	2,869,108.00	0.32
37	601928	凤凰传媒	288,600	2,796,534.00	0.31
38	002003	伟星股份	269,500	2,606,065.00	0.29
39	603786	科博达	45,800	2,441,598.00	0.27
40	002847	盐津铺子	41,220	2,399,004.00	0.27
41	301498	乖宝宠物	45,400	2,309,952.00	0.26
42	003010	若羽臣	70,600	2,128,590.00	0.24
43	002867	周大生	164,100	1,926,534.00	0.22
44	600729	重百集团	83,300	1,840,930.00	0.21
45	002946	新乳业	97,600	1,762,656.00	0.20
46	300492	华图山鼎	29,700	1,725,570.00	0.19
47	603202	天有为	18,100	1,716,604.00	0.19
48	603049	中策橡胶	33,033	1,572,370.80	0.18
49	300926	博俊科技	49,221	1,389,508.83	0.16
50	002612	朗姿股份	83,600	1,376,056.00	0.15

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）

1	688795	摩尔线程	3,199	1,262,037.49	0.14
2	688802	沐曦股份	2,330	969,093.60	0.11
3	688759	必贝特	12,552	398,651.52	0.04
4	688790	昂瑞微	2,319	242,938.44	0.03
5	001280	中国铀业	2,277	164,945.88	0.02
6	301682	宏明电子	714	80,682.00	0.01
7	688818	电科蓝天	1,717	74,620.82	0.01
8	301683	慧谷新材	952	74,617.76	0.01
9	688809	强一股份	259	63,532.70	0.01
10	688813	泰金新能	2,337	61,416.36	0.01
11	301638	南网数字	2,322	59,350.32	0.01
12	001257	盛龙股份	5,807	45,410.74	0.01
13	688796	百奥赛图	423	32,186.07	0.00
14	001386	马可波罗	1,626	32,032.20	0.00
15	688807	优迅股份	131	25,501.77	0.00
16	001233	海安集团	370	22,521.90	0.00
17	301563	云汉芯城	110	16,126.00	0.00
18	603175	超颖电子	169	13,749.84	0.00
19	301667	纳百川	151	12,537.53	0.00
20	001369	双欣材料	897	10,952.37	0.00
21	301680	固德电材	117	10,657.53	0.00
22	688816	易思维	177	9,812.88	0.00
23	603092	德力佳	146	9,495.84	0.00
24	601026	道生天合	451	8,645.67	0.00
25	301687	新广益	195	8,293.35	0.00
26	301449	天溯计量	112	7,963.20	0.00
27	001285	瑞立科密	137	6,873.29	0.00
28	603248	锡华科技	260	6,416.80	0.00
29	603334	丰倍生物	88	4,415.84	0.00
30	001220	世盟股份	57	1,871.31	0.00
31	603284	林平发展	46	1,846.90	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	600519	贵州茅台	7,269,558.75	0.78
2	000333	美的集团	6,713,480.00	0.72
3	000651	格力电器	3,355,680.00	0.36
4	600887	伊利股份	3,261,883.00	0.35
5	002714	牧原股份	2,481,299.00	0.27
6	600660	福耀玻璃	1,877,787.00	0.20
7	600690	海尔智家	1,842,710.00	0.20
8	601127	赛力斯	1,700,954.00	0.18

9	300498	温氏股份	1,680,243.00	0.18
10	601888	中国中免	1,614,090.00	0.17
11	600809	山西汾酒	1,568,464.00	0.17
12	002027	分众传媒	1,408,362.00	0.15
13	603288	海天味业	1,185,770.00	0.13
14	601058	赛轮轮胎	776,836.00	0.08
15	002920	德赛西威	703,600.18	0.08
16	689009	九号公司	580,952.27	0.06
17	688169	石头科技	565,526.89	0.06
18	002472	双环传动	546,407.00	0.06
19	300251	光线传媒	520,058.00	0.06
20	600873	梅花生物	424,390.00	0.05

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	688818	电科蓝天	1,007,318.42	0.11
2	600930	华电新能	836,461.18	0.09
3	301682	宏明电子	234,546.00	0.03
4	688816	易思维	156,119.48	0.02
5	301680	固德电材	136,630.00	0.01
6	688729	屹唐股份	83,197.55	0.01
7	001220	世盟股份	31,699.50	0.00
8	603284	林平发展	26,655.50	0.00
9	301632	广东建科	15,586.00	0.00
10	301609	山大电力	13,994.81	0.00
11	301491	汉桑科技	13,739.50	0.00
12	001221	悍高集团	10,780.60	0.00
13	301668	昊创瑞通	8,818.40	0.00
14	603418	友升股份	7,296.94	0.00
15	603406	天富龙	5,913.10	0.00
16	603262	技源集团	4,445.05	0.00
17	001388	信通电子	4,031.66	0.00
18	603370	华新精科	3,763.80	0.00

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	46,642,421.46
卖出股票收入（成交）总额	2,600,997.49

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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	301,242.41
2	应收清算款	8,813.43
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,540,902.04
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,850,957.88

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688795	摩尔线程	1,262,037.49	0.14	新股锁定
2	688802	沐曦股份	969,093.60	0.11	新股锁定
3	688759	必贝特	398,651.52	0.04	新股锁定
4	688790	昂瑞微	242,938.44	0.03	新股锁定
5	001280	中国铀业	164,945.88	0.02	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（转型后）

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（%）
华宝中证消费龙头 ETF 联接 A	60,234	11,211.03	15,230,451.02	2.26	660,054,943.79	97.74
华宝中证消费龙头 ETF 联接 C	41,229	3,424.58	3,910,770.58	2.77	137,281,285.17	97.23
合计	101,463	8,047.05	19,141,221.60	2.34	797,336,228.96	97.66

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	华宝中证消费龙头 ETF 联接 A	802,404.18	0.1188
	华宝中证消费龙头 ETF 联接 C	133,827.45	0.0948
	合计	936,231.63	0.1147

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	华宝中证消费龙头 ETF 联接 A	0
	华宝中证消费龙头 ETF 联接 C	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	华宝中证消费龙头 ETF 联接 A	0
	华宝中证消费龙头 ETF 联接 C	0
	合计	0

§8 基金份额持有人信息（转型前）

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（%）
消费龙头 LOF	63,012	10,309.99	13,417,547.02	2.07	636,235,581.70	97.93
华宝消费龙头 C	44,129	3,239.50	172,710.71	0.12	142,783,356.58	99.88
合计	107,141	7,397.81	13,590,257.73	1.71	779,018,938.30	98.29

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	华宝中证消费龙头 ETF 联接 A	802,404.18	0.1235

有从业人员持有本基金	华宝中证消费龙头 ETF 联接 C	129,193.10	0.0904
	合计	931,597.28	0.1175

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	消费龙头 LOF	0
	华宝消费龙头 C	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	消费龙头 LOF	0
	华宝消费龙头 C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

项目	华宝中证消费龙头 ETF 联接 A	华宝中证消费龙头 ETF 联接 C
基金合同生效日（2026 年 3 月 27 日）基金份额总额	649,653,128.72	142,956,067.29
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	69,375,220.78	41,053,692.47
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	43,742,954.69	42,817,704.01
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	675,285,394.81	141,192,055.75

注：本基金合同生效日于 2026 年 03 月 27 日，份额变动日期为 2026 年 3 月 27 日至 2026 年 6 月 30 日。

§9 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

项目	消费龙头 LOF	华宝消费龙头 C

基金合同生效日（2019 年 12 月 19 日）基金份额总额	288,580,786.84	-
本报告期期初基金份额总额	610,130,518.32	146,732,265.16
本报告期基金总申购份额	78,823,706.83	55,893,942.81
减：本报告期基金总赎回份额	39,301,096.43	59,670,140.68
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	649,653,128.72	142,956,067.29

注：本基金合同生效日于 2019 年 12 月 19 日，份额变动日期为 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 3 月 26 日。。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金以通讯开会方式召开了基金份额持有人大会，大会表决投票时间自 2026 年 2 月 6 日起至 2026 年 3 月 5 日 17:00 止，会议审议通过了《关于华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）修改基金合同有关事项的议案》。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。

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

根据本基金的基金管理人华宝基金管理有限公司于 2026 年 3 月 25 日发布的《关于华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)变更为华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）并修订基金合同等法律文件的公告》，自 2026 年 3 月 27 日起华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)转型为本基金。

转型前投资策略：本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。

转型后的投资策略：本基金为 ETF 联接基金，主要通过投资于目标 ETF 实现对标的指数的紧密跟踪。

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

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(转型后)

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(%)	
中信证券	2	468,493,480.51	100.00	87,102.67	100.00	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-

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。

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		基金交易	
	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(%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例(%)
中信证券	-	-	-	-	-	-	62,039,943.30	100.00
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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(转型前)

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(%)	
中信证券	2	48,534,026.33	100.00	9,028.92	100.00	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-

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。

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（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华宝基金关于旗下部分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	2026-01-16
2	华宝中证消费龙头指数证券投资基金（LOF）2025 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2026-01-22
3	华宝基金管理有限公司关于以通讯方式二次召开华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会的公告	基金管理人网站,中国证券报	2026-02-03
4	华宝基金管理有限公司关于以通讯方式二次召开华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会的第一次提示性公告	基金管理人网站,中国证券报	2026-02-04
5	华宝基金管理有限公司关于以通讯方式二次召开华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会的第二次提示性公告	基金管理人网站,中国证券报	2026-02-05
6	华宝中证消费龙头指数证券投资基金（LOF）基金经理变更公告	基金管理人网站,中国证券报	2026-02-12
7	华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)招募说明书（更新）	基金管理人网站	2026-02-13
8	华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)（A 类份额）基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站	2026-02-13
9	华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)（C 类份额）基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站	2026-02-13
10	华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)基金合同	基金管理人网站	2026-03-09
11	华宝基金管理有限公司关于华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)修改基金合同的公告	基金管理人网站,中国证券报	2026-03-09
12	华宝基金管理有限公司关于华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)基	基金管理人网站,中国证券报	2026-03-09

	金份额持有人大会（二次召开）表决结果暨决议生效的公告		
13	华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)招募说明书（更新）	基金管理人网站	2026-03-09
14	关于华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)变更为华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）并修订基金合同等法律文件的公告	基金管理人网站,中国证券报	2026-03-25
15	华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金合同	基金管理人网站	2026-03-25
16	华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）托管协议	基金管理人网站	2026-03-25
17	华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）招募说明书（更新）	基金管理人网站	2026-03-25
18	华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）（A 类份额）基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站	2026-03-25
19	华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）（C 类份额）基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站	2026-03-25
20	华宝中证消费龙头指数证券投资基金（LOF）2025 年年度报告	基金管理人网站	2026-03-31
21	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
22	华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）2026 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2026-04-22
23	华宝基金关于旗下部分基金新增南京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	2026-04-24
24	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
25	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
26	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

10.8 其他重大事件（转型前）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华宝基金关于旗下部分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	2026-01-16
2	华宝中证消费龙头指数证券投资基金（LOF）2025 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2026-01-22
3	华宝基金管理有限公司关于以通讯方式二次召开华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会的公告	基金管理人网站,中国证券报	2026-02-03
4	华宝基金管理有限公司关于以通讯方式二次召开华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会的第一次提示性公告	基金管理人网站,中国证券报	2026-02-04
5	华宝基金管理有限公司关于以通讯方式二次召开华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会的第二次提示性公告	基金管理人网站,中国证券报	2026-02-05
6	华宝中证消费龙头指数证券投资基金（LOF）基金经理变更公告	基金管理人网站,中国证券报	2026-02-12
7	华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)招募说明书（更新）	基金管理人网站	2026-02-13
8	华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)（A 类份额）基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站	2026-02-13
9	华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)（C 类份额）基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站	2026-02-13
10	华宝基金管理有限公司关于华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会（二次召开）表决结果暨决议生效的公告	基金管理人网站,中国证券报	2026-03-09
11	华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)招募说明书（更新）	基金管理人网站	2026-03-09
12	华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)基金合同	基金管理人网站	2026-03-09
13	华宝基金管理有限公司关于华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)修改基金合同的公告	基金管理人网站,中国证券报	2026-03-09
14	关于华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)变更为华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）并修订基金合同等法律文	基金管理人网站,中国证券报	2026-03-25

	件的公告		
15	华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金合同	基金管理人网站	2026-03-25
16	华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）（A 类份额）基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站	2026-03-25
17	华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）招募说明书（更新）	基金管理人网站	2026-03-25
18	华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）托管协议	基金管理人网站	2026-03-25
19	华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）（C 类份额）基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站	2026-03-25

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于 2026 年 02 月 03 日发布华宝基金管理有限公司关于以通讯方式二次召开华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会的公告，于 2026 年 03 月 09 日发布华宝基金管理有限公司关于华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)修改基金合同的公告，于 2026 年 03 月 09 日发布华宝基金管理有限公司关于华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会（二次召开）表决结果暨决议生效的公告，于 2026 年 03 月 25 日发布关于华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)变更为华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）并修订基金合同等法律文件的公告，具体内容详见公司公告，请投资者予以关注。

§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；

华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金合同；

华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）招募说明书；

华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）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