

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 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：平安银行股份有限公司

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。

基金托管人平安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	6
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	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§ 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	11
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	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
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	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
§ 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	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
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	46

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	46
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	46
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	47
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	47
7.11 本基金投资股指期货的投资政策	47
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.13 投资组合报告附注	47
§ 8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
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	49
§ 9 开放式基金份额变动	49
§ 10 重大事件揭示	50
10.1 基金份额持有人大会决议	50
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	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	50
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	51
10.8 其他重大事件	51
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	53
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	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	53
§ 12 备查文件目录	53
12.1 备查文件目录	53
12.2 存放地点	53
12.3 查阅方式	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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	
基金简称	华宝上证科创板综合增强策略 ETF 联接	
基金主代码	024752	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 9 月 16 日	
基金管理人	华宝基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	81,678,467.81 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华宝上证科创板综合增强策略 ETF 联接 A	华宝上证科创板综合增强策略 ETF 联接 C
下属分级基金的交易代码	024752	024753
报告期末下属分级基金的份额总额	6,857,896.04 份	74,820,571.77 份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	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
基金主代码	589280
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2026 年 5 月 8 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2026 年 5 月 20 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	平安银行股份有限公司

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过投资于目标 ETF，在力求有效跟踪标的指数基础上，力争获取超越指数表现的投资收益。
投资策略	本基金为 ETF 联接基金，主要通过投资于目标 ETF 实现对标的指数的有效跟踪。本基金的风险控制目标为力争使基金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 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。 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。
业绩比较基准	上证科创板综合指数收益率×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 为股票型基金，预期风险与预期收益理论上高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

	本基金投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于股价波动风险、流动性风险、退市风险和投资集中风险等。
--	--

2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过量化的方法进行积极的组合管理与严格的风险控制，力争实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金主要投资于上证科创板综合指数成份股及备选成份股。本基金股票投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于标的指数成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。大类资产配置不作为本基金的核心策略。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出合适调整。
业绩比较基准	上证科创板综合指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华宝基金管理有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周雷	潘琦
	联系电话	021-38505888	0755-22168257
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	PANQI003@pingan.com.cn
客户服务电话		400-700-5588、400-820-5050	95511-3
传真		021-38505777	0755-82080387
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	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 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	广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座
邮政编码		200120	518001
法定代表人		夏雪松	谢永林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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)	
	华宝上证科创板综合增强策略 ETF 联接 A	华宝上证科创板综合增强策略 ETF 联接 C
本期已实现收益	3,118,278.41	24,379,339.42
本期利润	4,975,481.31	38,078,696.49
加权平均基金份额 本期利润	0.3586	0.3611
本期加权平均净 值利润率	31.32%	31.34%
本期基金份额净 值增长率	37.74%	37.53%
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	2,067,457.64	22,321,590.68
期末可供分配基 金份额利润	0.3015	0.2983
期末基金资产净 值	9,776,106.30	106,405,147.89
期末基金份额净 值	1.4255	1.4221
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	42.55%	42.21%

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

华宝上证科创板综合增强策略 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	38.34%	1.98%	52.44%	2.24%	-14.10%	-0.26%
过去六个月	37.74%	1.92%	50.92%	2.11%	-13.18%	-0.19%
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	42.55%	1.66%	53.82%	1.92%	-11.27%	-0.26%

华宝上证科创板综合增强策略 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	38.24%	1.97%	52.44%	2.24%	-14.20%	-0.27%
过去六个月	37.53%	1.92%	50.92%	2.11%	-13.39%	-0.19%
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	42.21%	1.66%	53.82%	1.92%	-11.61%	-0.26%

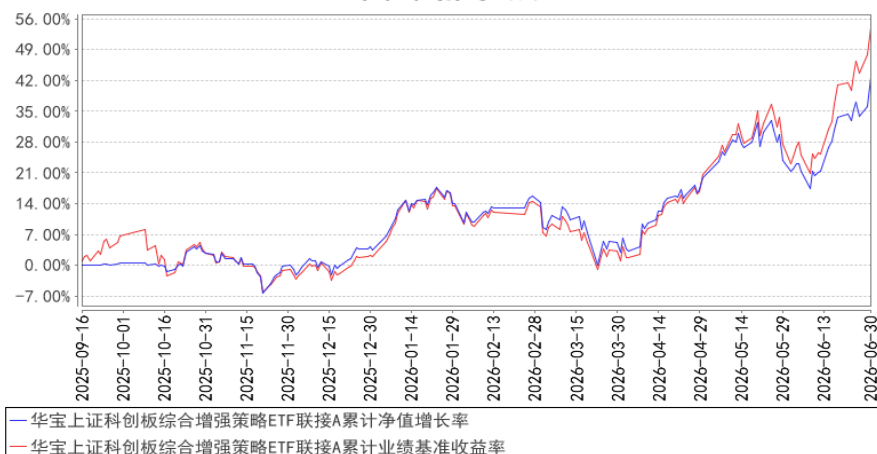
注：（1）基金业绩基准：上证科创板综合指数收益率×95%+人民币银行活期存款利率（税后）×

5%;

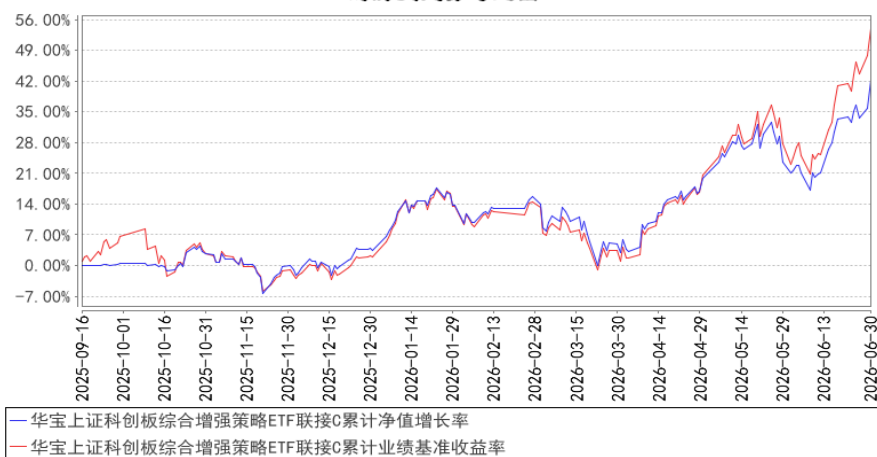
(2) 净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的, 包括所有交易日以及季末最后一自然日(如非交易日)。

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

华宝上证科创板综合增强策略ETF联接A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



华宝上证科创板综合增强策略ETF联接C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注: 1、本基金基金合同生效于 2025 年 09 月 16 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 2026 年 03 月 16 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		
喻银尤	本基金基金经理	2025-09-16	-	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

上半年 A 股极致分化，科技成长板块一枝独秀，传统行业则普遍低迷。市场成交保持活跃，资金高度聚焦人工智能、半导体等新质生产力方向，而消费、地产、金融等权重板块持续承压。指数间严重背离，创业板与科创板表现远强于主板，多数个股跑输指数，赚钱效应集中于少数领域。政策持续加码科技创新，但经济复苏基础尚不牢固，外部不确定性扰动频繁，市场风险偏好起伏较大，整体呈现鲜明的结构性行情特征。

本基金通过实证分析和动态跟踪得到有效因子，再根据有效因子的综合评分结果得到最终模型即基金组合。目标为追求稳定高性价比的超额收益策略。

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 37.74%，本报告期基金份额 C 类净值增长率为 37.53%；同期业绩比较基准收益率为 50.92%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，宏观经济在政策托底下有望企稳，但经济结构“K 型分化”特征或将延续。政策定调“加大逆周期调节力度”，财政与产业政策协同发力，广义财政支出有望温和回升。证券市场方面，行情核心驱动力正从上半年的“拔估值”切换至“业绩兑现”。预计将呈现结构性行情，风格趋于均衡。行业走势上，AI 与科技或仍将是市场主线，但板块内部分化加剧，投资逻辑将高度聚焦。除科技主线外，可关注 AI 资本支出外溢的衍生板块（如数据中心、电力设备等），以及锂电池、化工等正经历盈利复苏的领域。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、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

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	3,583,569.09	6,955,618.61
结算备付金		4,107,026.50	11,232,160.52
存出保证金		—	—
交易性金融资产	6.4.7.2	110,323,206.22	173,961,962.54
其中：股票投资		82,470,706.22	173,961,962.54
基金投资		27,852,500.00	—
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		184,456.99	88,862.06
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.5	—	—

资产总计		118,198,258.80	192,238,603.73
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		1,847,134.93	8,131,759.43
应付管理人报酬		62,164.09	137,374.35
应付托管费		8,449.32	17,171.78
应付销售服务费		24,105.00	43,858.60
应付投资顾问费		-	-
应交税费		23.45	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	75,127.82	55,000.12
负债合计		2,017,004.61	8,385,164.28
净资产:			
实收基金	6.4.7.7	81,678,467.81	177,783,320.63
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	34,502,786.38	6,070,118.82
净资产合计		116,181,254.19	183,853,439.45
负债和净资产总计		118,198,258.80	192,238,603.73

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 81,678,467.81 份，其中华宝上证科创板综合增强策略 ETF 联接 A 基金份额总额 6,857,896.04 份，基金份额净值 1.4255 元；华宝上证科创板综合增强策略 ETF 联接 C 基金份额总额 74,820,571.77 份，基金份额净值 1.4221 元。

6.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		43,917,304.74
1. 利息收入		8,291.63
其中：存款利息收入	6.4.7.9	8,291.63
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）		28,340,643.64
其中：股票投资收益	6.4.7.10	28,063,678.87
基金投资收益	6.4.7.11	-156.97
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	277,121.74
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	15,556,559.97
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	11,809.50
减：二、营业总支出		863,126.94
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	541,003.15
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	68,304.22
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	181,865.49
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		2.52
8. 其他费用	6.4.7.20	71,951.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		43,054,177.80
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		43,054,177.80
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		43,054,177.80

注：本产品成立于 2025 年 09 月 16 日，故无上年度可比期间。

6.3 净资产变动表

会计主体：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

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	177,783,320.63	-	6,070,118.82	183,853,439.45
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	177,783,320.63	-	6,070,118.82	183,853,439.45
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-96,104,852.82	-	28,432,667.56	-67,672,185.26
（一）、综合收益总额	-	-	43,054,177.80	43,054,177.80
（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）	-96,104,852.82	-	-14,621,510.24	-110,726,363.06
其中：1. 基金申购款	43,060,139.19	-	7,350,906.21	50,411,045.40
2. 基金赎回款	-139,164,992.01	-	-21,972,416.45	-161,137,408.46
（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	81,678,467.81	-	34,502,786.38	116,181,254.19

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（以下简称“本基金”），是由原华宝上证科创板综合指数增强型证券投资基金（以下简称“原基金”）转型而来。原基金经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2025]第 1265 号《关于准予华宝上证科创板综合指数增强型证券投资基金注册的批复》注册，由华宝基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。原基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 328,821,762.72 元，业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明（2025）验字第 70072895_B24 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华宝上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金合同》于 2025 年 9 月 16 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 328,895,451.64 份基金份额，其中认购资金利息折合 73,688.92 份基金份额。

根据本基金的基金管理人华宝基金管理有限公司于 2026 年 6 月 22 日发布的《关于华宝上证科创板综合指数增强型证券投资基金变更为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并修订基金合同等法律文件的公告》，自 2026 年 6 月 24 日起原基金转型为本基金，《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基金合同》自该日起生效，《华宝上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金合同》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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《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招募说明书》，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。

本基金为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(以下简称“目标 ETF”)的联接基金。目标 ETF 在力求有效跟踪上证科创板综合指数的基础上，通过量化方法积极管理并力争获取超额收益。本基金主要通过投资目标 ETF，在有效跟踪标的指数基础上力争获取超越指数表现的投资收益。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 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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基金合同》的有关规定，本基金主要投资于目标 ETF 基金份额、标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于国内依法发行上市的非成份股（包括创业板、科创板、存托凭证及其他经中国证监会允许上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、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）、股指期货、国债期货、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与转融通证券出借业务和融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，持有现金（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%。股指期货、国债期货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：上证科创板综合指数收益率 $\times$ 95%+人民币银行活期存款利率（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

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

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

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	3,583,569.09
等于：本金	3,583,304.80
加：应计利息	264.29
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	3,583,569.09

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		69,279,138.97	-	82,470,706.22	13,191,567.25
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		26,154,000.00	-	27,852,500.00	1,698,500.00
其他		-	-	-	-
合计		95,433,138.97	-	110,323,206.22	14,890,067.25

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	5.10
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	71,904.06
其他	3,218.66
合计	75,127.82

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

华宝上证科创板综合增强策略 ETF 联接 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	27,164,682.26	27,164,682.26
本期申购	4,023,932.54	4,023,932.54
本期赎回（以“-”号填列）	-24,330,718.76	-24,330,718.76
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	6,857,896.04	6,857,896.04

华宝上证科创板综合增强策略 ETF 联接 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	150,618,638.37	150,618,638.37
本期申购	39,036,206.65	39,036,206.65
本期赎回（以“-”号填列）	-114,834,273.25	-114,834,273.25
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	74,820,571.77	74,820,571.77

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

华宝上证科创板综合增强策略 ETF 联接 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,110,316.63	-161,771.33	948,545.30
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	1,110,316.63	-161,771.33	948,545.30
本期利润	3,118,278.41	1,857,202.90	4,975,481.31
本期基金份额交易产生的变动数	-2,161,137.40	-844,678.95	-3,005,816.35
其中：基金申购款	306,199.27	326,233.40	632,432.67
基金赎回款	-2,467,336.67	-1,170,912.35	-3,638,249.02
本期已分配利润	-	-	-

本期末	2,067,457.64	850,752.62	2,918,210.26
-----	--------------	------------	--------------

华宝上证科创板综合增强策略 ETF 联接 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,018,862.31	-897,288.79	5,121,573.52
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	6,018,862.31	-897,288.79	5,121,573.52
本期利润	24,379,339.42	13,699,357.07	38,078,696.49
本期基金份额交易产生的变动数	-8,076,611.05	-3,539,082.84	-11,615,693.89
其中：基金申购款	4,505,489.19	2,212,984.35	6,718,473.54
基金赎回款	-12,582,100.24	-5,752,067.19	-18,334,167.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	22,321,590.68	9,262,985.44	31,584,576.12

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	6,742.71
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	1,537.65
其他	11.27
合计	8,291.63

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	23,762,697.27
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	4,300,981.60
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	28,063,678.87

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	369,913,650.79
减：卖出股票成本总额	345,802,694.88
减：交易费用	348,258.64

买卖股票差价收入	23,762,697.27
----------	---------------

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1月1日至2026年6月30日
申购基金份额总额	26,154,000.00
减：现金支付申购款总额	-38,512.97
减：申购股票成本总额	21,891,531.37
减：交易费用	-
申购差价收入	4,300,981.60

6.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	-
减：卖出/赎回基金成本总额	-
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-
减：交易费用	156.97
基金投资收益	-156.97

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1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	277,121.74

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	277,121.74

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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	15,556,559.97
股票投资	13,858,059.97
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	1,698,500.00
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	15,556,559.97

6.4.7.18 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	11,006.31
基金转换费收入	803.19
合计	11,809.50

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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	12,396.69
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
存托服务费	47.50
合计	71,951.56

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
平安银行股份有限公司(“平安银行”)	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(“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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	541,003.15
其中：应支付销售机构的客户维护费	269,265.82
应支付基金管理人的净管理费	271,737.33

注：对于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，基金管理人

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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	68,304.22

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。本基金托管费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 0.1%的年费率计提。其计算公式为：

$$H = \text{MAX} (E \times 0.1\% \div \text{当年天数}, 0)$$

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扣除前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值。

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 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		
	华宝上证科创板综合 增强策略 ETF 联接 A	华宝上证科创板综合 增强策略 ETF 联接 C	合计
华宝基金	—	72.44	72.44
平安银行	—	114,525.61	114,525.61
合计	—	114,598.05	114,598.05

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 0.3%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： $H = E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$ ，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	
	期末余额	当期利息收入
平安银行	3,583,569.09	6,742.71

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，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 25,000,000.00 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 28.07%。

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	证	成功	受	流通	认购	期末估	数量	期末	期末估值总	备注

代码	券名称	认购日	限期	受限类型	价格	值单价	(单位:股)	成本总额	额	
601112	振石股份	2026年1月21日	6个月	新股锁定	11.18	17.59	155	1,732.90	2,726.45	-
603284	林平发展	2026年2月3日	6个月	新股锁定	37.88	34.87	32	1,212.16	1,115.84	-
603293	埃泰克	2026年4月9日	6个月	新股锁定	33.49	33.93	22	736.78	746.46	-
603407	长裕集团	2026年4月29日	6个月	新股锁定	13.86	73.46	81	1,122.66	5,950.26	-
603435	嘉德利	2026年5月15日	6个月	新股锁定	15.76	46.71	56	882.56	2,615.76	-
688635	长进光子	2026年5月20日	6个月	新股锁定	40.98	308.19	51	2,089.98	15,717.69	-
688712	北芯生命	2026年1月28日	6个月	新股锁定	17.52	35.92	675	11,826.00	24,246.00	-
688785	恒运昌	2026年1月20日	6个月	新股锁定	92.18	463.15	44	4,055.92	20,378.60	-
688790	昂瑞微	2025年12月9日	9个月	新股锁定	83.06	126.45	580	48,174.80	73,341.00	-
688795	摩尔线程	2025年11月26日	9个月	新股锁定	114.28	676.94	738	84,338.64	499,581.72	-
688802	沐	2025	9个月	新股	104.66	768.89	533	55,783.78	409,818.37	-

	曦股份	年 12 月 9 日		锁定						
688808	联讯仪器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新股锁定	81.88	1,584.33	31	2,538.28	49,114.23	-
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定	26.28	172.09	100	2,628.00	17,209.00	-
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股锁定	55.95	57.10	66	3,692.70	3,768.60	-
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股锁定	9.47	70.14	479	4,536.13	33,597.06	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁定	19.68	141.49	178	3,503.04	25,185.22	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	832.00	2026 年 7 月 13 日	890.99	800	299,240.87	665,600.00	-
688260	昀冢科技	2026 年 6 月 26 日	重大事项停牌	144.00	2026 年 7 月 1 日	132.00	3,023	117,993.67	435,312.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购，因此没有在进行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部控制制度的执行情况履行检查、评价、报告和建议职能。风险管理部在督察长指导下对公司内部控制运行情况进行监控，主要针对公司内部控制制度的总体构架和内部控制的目标进行评估并提出改进意见；合规审计部在督察长的领导下对各部门和岗位的内部控制执行情况进行监督和核查，同时对内控的失控点进行查漏并责令改正。

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款均存放于大型股份制商业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于本报告期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金净资产的比例较低（含债券投资比例为零），因此无重大信用风险（上年度末：同）。

6.4.13.3 流动性风险

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

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，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。

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	3,583,569.09	-	-	-	3,583,569.09
结算备付金	4,107,026.50	-	-	-	4,107,026.50
交易性金融资产	-	-	-	110,323,206.22	110,323,206.22
应收申购款	-	-	-	184,456.99	184,456.99
资产总计	7,690,595.59	-	-	110,507,663.21	118,198,258.80
负债					

应付赎回款	-	-	-	1,847,134.93	1,847,134.93
应付管理人报酬	-	-	-	62,164.09	62,164.09
应付托管费	-	-	-	8,449.32	8,449.32
应付销售服务费	-	-	-	24,105.00	24,105.00
应交税费	-	-	-	23.45	23.45
其他负债	-	-	-	75,127.82	75,127.82
负债总计	-	-	-	2,017,004.61	2,017,004.61
利率敏感度缺口	7,690,595.59	-	-	-108,490,658.60	116,181,254.19
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	6,955,618.61	-	-	-	6,955,618.61
结算备付金	11,232,160.52	-	-	-	11,232,160.52
交易性金融资产	-	-	-	-173,961,962.54	173,961,962.54
应收申购款	-	-	-	88,862.06	88,862.06
资产总计	18,187,779.13	-	-	-174,050,824.60	192,238,603.73
负债					
应付赎回款	-	-	-	8,131,759.43	8,131,759.43
应付管理人报酬	-	-	-	137,374.35	137,374.35
应付托管费	-	-	-	17,171.78	17,171.78
应付销售服务费	-	-	-	43,858.60	43,858.60
其他负债	-	-	-	55,000.12	55,000.12
负债总计	-	-	-	8,385,164.28	8,385,164.28
利率敏感度缺口	18,187,779.13	-	-	-165,665,660.32	183,853,439.45

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		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	82,470,706.22	70.98	173,961,962.54	94.62
交易性金融资产—基金投资	27,852,500.00	23.97	—	—
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	110,323,206.22	94.96	173,961,962.54	94.62

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

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

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	108,037,181.96	171,404,384.68
第二层次	1,100,912.00	1,929,500.00
第三层次	1,185,112.26	628,077.86
合计	110,323,206.22	173,961,962.54

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	82,470,706.22	69.77
	其中：股票	82,470,706.22	69.77
2	基金投资	27,852,500.00	23.56
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	7,690,595.59	6.51
8	其他各项资产	184,456.99	0.16
9	合计	118,198,258.80	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	384,291.00	0.33
B	采矿业	-	-
C	制造业	64,094,607.10	55.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	227,395.00	0.20
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	183,366.00	0.16
G	交通运输、仓储和邮政业	221,704.00	0.19
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,348,447.74	13.21
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	1,371,033.64	1.18
N	水利、环境和公共设施管理业	639,861.74	0.55
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	82,470,706.22	70.98

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	688256	寒武纪	3,126	4,987,689.30	4.29
2	688041	海光信息	11,271	4,173,651.30	3.59
3	688012	中微公司	3,411	1,598,053.50	1.38
4	688795	摩尔线程	2,154	1,514,131.56	1.30
5	688802	沐曦股份	1,713	1,387,212.37	1.19
6	688008	澜起科技	3,289	1,019,261.10	0.88
7	688981	中芯国际	5,989	951,172.98	0.82
8	688072	拓荆科技	800	665,600.00	0.57
9	688360	德马科技	34,374	615,294.60	0.53
10	688525	佰维存储	1,234	610,496.82	0.53
11	688498	源杰科技	315	594,090.00	0.51
12	688299	长阳科技	35,067	585,969.57	0.50
13	688653	康希通信	32,712	568,534.56	0.49
14	688629	华丰科技	2,949	552,966.99	0.48
15	688396	华润微	5,612	547,450.60	0.47
16	688107	安路科技	11,421	520,797.60	0.45
17	688388	嘉元科技	11,287	496,628.00	0.43
18	688728	格科微	23,455	493,493.20	0.42
19	688475	萤石网络	17,985	491,889.75	0.42
20	688082	盛美上海	1,110	479,520.00	0.41
21	688469	芯联集成	43,631	462,924.91	0.40
22	688613	奥精医疗	32,746	462,046.06	0.40
23	688334	西高院	24,535	445,064.90	0.38
24	688432	有研硅	11,097	443,547.09	0.38
25	688151	华强科技	29,821	443,438.27	0.38
26	688036	传音控股	7,460	439,767.00	0.38
27	688146	中船特气	1,256	439,587.44	0.38
28	688385	复旦微电	6,165	439,502.85	0.38
29	688259	创耀科技	11,162	436,657.44	0.38
30	688372	伟测科技	2,347	436,542.00	0.38
31	688260	昀冢科技	3,023	435,312.00	0.37
32	688077	大地熊	16,274	431,098.26	0.37
33	688279	峰昭科技	1,915	429,802.60	0.37
34	688186	广大特材	28,239	427,820.85	0.37
35	688209	英集芯	14,706	427,650.48	0.37
36	688697	纽威数控	31,437	427,228.83	0.37
37	688071	华依科技	11,593	422,448.92	0.36
38	688678	福立旺	17,261	417,198.37	0.36
39	688620	安凯微	25,623	415,092.60	0.36
40	688609	九联科技	37,540	413,315.40	0.36

41	688361	中科飞测	961	413,230.00	0.36
42	688252	天德钰	17,190	412,560.00	0.36
43	688220	翱捷科技	3,296	409,758.72	0.35
44	688693	锆威特	3,865	401,766.75	0.35
45	688141	杰华特	2,603	399,560.50	0.34
46	688084	晶品特装	7,748	389,569.44	0.34
47	688687	凯因科技	23,724	386,938.44	0.33
48	688286	敏芯股份	3,348	385,254.36	0.33
49	688403	汇成股份	9,699	385,050.30	0.33
50	600540	新赛股份	116,100	384,291.00	0.33
51	688352	硕中科技	15,567	376,410.06	0.32
52	688079	美迪凯	12,190	374,842.50	0.32
53	688002	睿创微纳	2,416	373,731.04	0.32
54	688612	威迈斯	12,477	369,194.43	0.32
55	688249	晶合集成	6,200	365,986.00	0.32
56	688538	和辉光电	140,406	365,055.60	0.31
57	688711	宏微科技	7,959	361,736.55	0.31
58	688126	沪硅产业	9,052	361,084.28	0.31
59	688775	影石创新	2,566	355,775.90	0.31
60	688110	东芯股份	1,716	349,549.20	0.30
61	688210	统联精密	8,586	347,818.86	0.30
62	688589	力合微	15,127	347,618.46	0.30
63	688153	唯捷创芯	10,810	347,217.20	0.30
64	688049	炬芯科技	7,308	342,818.28	0.30
65	688798	艾为电子	4,673	342,624.36	0.29
66	688800	瑞可达	3,527	338,486.19	0.29
67	688608	恒玄科技	2,006	335,383.14	0.29
68	688521	芯原股份	894	331,799.16	0.29
69	688593	新相微	8,455	329,068.60	0.28
70	688586	江航装备	27,941	326,630.29	0.28
71	688595	芯海科技	7,434	326,055.24	0.28
72	688150	莱特光电	4,715	323,543.30	0.28
73	688172	燕东微	3,841	321,338.06	0.28
74	688262	国芯科技	7,430	321,198.90	0.28
75	688045	必易微	3,953	319,323.34	0.27
76	688195	腾景科技	1,649	317,564.42	0.27
77	688707	振华新材	24,696	317,343.60	0.27
78	688709	成都华微	8,296	315,994.64	0.27
79	688181	八亿时空	5,021	314,314.60	0.27
80	688478	晶升股份	3,536	313,112.80	0.27
81	688484	南芯科技	5,513	311,429.37	0.27
82	688009	中国通号	65,416	311,380.16	0.27
83	688063	派能科技	5,843	311,256.61	0.27

84	688230	芯导科技	3,943	310,747.83	0.27
85	688246	嘉和美康	15,048	309,236.40	0.27
86	688332	中科蓝讯	1,960	308,700.00	0.27
87	688208	道通科技	12,233	308,149.27	0.27
88	688536	思瑞浦	840	305,835.60	0.26
89	688779	五矿新能	37,207	301,748.77	0.26
90	688093	世华科技	8,173	301,583.70	0.26
91	688458	美芯晟	7,215	301,298.40	0.26
92	688182	灿勤科技	6,977	300,499.39	0.26
93	688135	利扬芯片	7,140	300,451.20	0.26
94	688120	华海清科	931	299,949.58	0.26
95	688508	芯朋微	3,217	299,052.32	0.26
96	688347	华虹宏力	889	298,970.70	0.26
97	688219	会通股份	23,040	298,137.60	0.26
98	688167	炬光科技	837	296,473.77	0.26
99	688702	盛科通信	759	296,002.41	0.25
100	688010	福光股份	6,080	295,670.40	0.25
101	688530	欧莱新材	3,033	293,897.70	0.25
102	688123	聚辰股份	1,379	293,175.40	0.25
103	688480	赛恩斯	3,341	292,638.19	0.25
104	688561	奇安信	12,192	292,364.16	0.25
105	688699	明微电子	3,555	291,332.25	0.25
106	688322	奥比中光	2,227	290,734.85	0.25
107	688020	方邦股份	1,161	289,785.60	0.25
108	688486	龙迅股份	4,539	288,589.62	0.25
109	688080	映翰通	6,648	287,526.00	0.25
110	688380	中微半导	4,360	287,367.60	0.25
111	688007	光峰科技	21,592	287,173.60	0.25
112	688128	中国电研	12,078	286,731.72	0.25
113	688488	艾迪药业	22,277	286,259.45	0.25
114	688127	蓝特光学	2,899	282,942.40	0.24
115	688328	深科达	2,955	282,793.50	0.24
116	688720	艾森股份	2,792	281,992.00	0.24
117	688362	甬矽电子	2,917	281,198.80	0.24
118	688290	景业智能	4,219	279,972.84	0.24
119	688518	联赢激光	9,038	279,274.20	0.24
120	688717	艾罗能源	3,367	278,013.19	0.24
121	688639	华恒生物	17,172	277,156.08	0.24
122	688679	通源环境	6,481	272,785.29	0.23
123	688590	新致软件	21,887	272,055.41	0.23
124	688448	磁谷科技	4,232	268,985.92	0.23
125	688173	希荻微	14,036	268,649.04	0.23
126	688183	生益电子	2,007	265,726.80	0.23

127	688223	晶科能源	55,679	264,475.25	0.23
128	688472	阿特斯	24,259	262,482.38	0.23
129	688085	三友医疗	21,869	261,771.93	0.23
130	688169	石头科技	2,678	254,329.66	0.22
131	688371	菲沃泰	6,498	253,357.02	0.22
132	688365	光云科技	16,063	253,313.51	0.22
133	688577	浙海德曼	5,464	250,415.12	0.22
134	688213	思特威	2,337	250,222.59	0.22
135	688510	航亚科技	10,363	247,468.44	0.21
136	688390	固德威	2,268	246,100.68	0.21
137	688512	慧智微	15,307	244,452.79	0.21
138	688750	金天钛业	14,669	243,945.47	0.21
139	688766	普冉股份	315	241,479.00	0.21
140	603345	安井食品	3,000	240,570.00	0.21
141	688200	华峰测控	456	239,445.60	0.21
142	688584	上海合晶	6,654	239,211.30	0.21
143	688591	泰凌微	6,897	237,118.86	0.20
144	600872	中炬高新	13,600	236,096.00	0.20
145	688099	晶晨股份	2,280	234,612.00	0.20
146	688655	迅捷兴	4,367	233,896.52	0.20
147	688234	天岳先进	1,348	233,891.48	0.20
148	688052	纳芯微	809	233,242.79	0.20
149	688772	珠海冠宇	11,828	232,183.64	0.20
150	688187	时代电气	3,379	232,002.14	0.20
151	600037	歌华有线	36,900	231,363.00	0.20
152	688409	富创精密	747	228,768.75	0.20
153	603817	海峡环保	44,500	227,395.00	0.20
154	688216	气派科技	5,307	222,947.07	0.19
155	688369	致远互联	10,574	222,159.74	0.19
156	600029	南方航空	42,800	221,704.00	0.19
157	688556	高测股份	16,563	219,956.64	0.19
158	688005	容百科技	7,067	216,250.20	0.19
159	688722	同益中	14,239	216,005.63	0.19
160	688349	三一重能	14,164	215,009.52	0.19
161	603100	川仪股份	11,900	214,795.00	0.18
162	688658	悦康药业	16,678	214,479.08	0.18
163	688016	心脉医疗	2,412	213,799.68	0.18
164	688108	赛诺医疗	11,521	213,484.13	0.18
165	688117	圣诺生物	7,847	212,104.41	0.18
166	688111	金山办公	991	211,132.55	0.18
167	688292	浩瀚深度	11,306	210,291.60	0.18
168	688399	硕世生物	4,593	208,476.27	0.18
169	688677	海泰新光	2,029	205,192.77	0.18

170	688757	胜科纳米	3,071	204,835.70	0.18
171	688095	福昕软件	3,434	204,082.62	0.18
172	688333	铂力特	1,979	202,649.60	0.17
173	688519	南亚新材	527	200,281.08	0.17
174	688553	汇宇制药	18,658	198,334.54	0.17
175	688148	芳源股份	23,099	198,189.42	0.17
176	688350	富淼科技	5,699	196,786.47	0.17
177	688367	工大高科	5,896	196,336.80	0.17
178	688351	微电生理	8,617	195,261.22	0.17
179	688356	键凯科技	2,524	194,549.92	0.17
180	688500	慧辰股份	4,258	193,015.14	0.17
181	688303	大全能源	10,876	189,568.68	0.16
182	688190	云路股份	2,087	189,311.77	0.16
183	600267	海正药业	18,300	185,013.00	0.16
184	603233	大参林	12,200	183,366.00	0.16
185	603387	基蛋生物	24,100	182,196.00	0.16
186	688580	伟思医疗	3,385	180,318.95	0.16
187	688778	厦钨新能	3,236	176,038.40	0.15
188	688301	奕瑞科技	1,306	161,944.00	0.14
189	688289	圣湘生物	11,206	161,366.40	0.14
190	688225	亚信安全	12,908	160,317.36	0.14
191	688321	微芯生物	5,898	155,294.34	0.13
192	688599	天合光能	10,902	153,936.24	0.13
193	688621	阳光诺和	2,727	149,739.57	0.13
194	688326	经纬恒润	2,087	147,926.56	0.13
195	688439	振华风光	3,168	146,361.60	0.13
196	688199	久日新材	4,219	145,682.07	0.13
197	688097	博众精工	2,299	144,951.95	0.12
198	688696	极米科技	2,201	142,052.54	0.12
199	688567	孚能科技	13,393	140,626.50	0.12
200	688159	有方科技	3,090	137,165.10	0.12
201	688692	达梦数据	551	134,603.79	0.12
202	688218	江苏北人	2,419	132,948.24	0.11
203	688023	安恒信息	3,561	130,759.92	0.11
204	688152	麒麟信安	4,739	130,227.72	0.11
205	688275	万润新能	1,017	129,718.35	0.11
206	688636	智明达	3,498	126,732.54	0.11
207	688560	明冠新材	10,569	125,242.65	0.11
208	688522	纳睿雷达	6,120	122,522.40	0.11
209	688215	瑞晟智能	2,980	119,676.80	0.10
210	688615	合合信息	1,056	119,433.60	0.10
211	688682	霍莱沃	3,024	117,633.60	0.10
212	688523	航天环宇	2,237	117,218.80	0.10

213	688291	金橙子	1,982	115,907.36	0.10
214	688103	国力电子	1,515	112,731.15	0.10
215	688295	中复神鹰	1,825	110,485.50	0.10
216	688280	精进电动	20,011	109,860.39	0.09
217	688306	均普智能	10,712	108,191.20	0.09
218	688158	优刻得	2,868	105,427.68	0.09
219	688330	宏力达	3,101	104,906.83	0.09
220	689009	九号公司	2,682	102,318.30	0.09
221	688499	利元亨	1,947	102,314.85	0.09
222	688733	壹石通	2,446	101,142.10	0.09
223	688006	杭可科技	2,730	99,781.50	0.09
224	688327	云从科技	8,002	99,704.92	0.09
225	688585	上纬新材	600	99,480.00	0.09
226	688258	卓易信息	839	99,455.06	0.09
227	688598	金博股份	1,993	98,553.85	0.08
228	688428	诺诚健华	3,450	98,221.50	0.08
229	688698	伟创电气	1,819	95,406.55	0.08
230	688345	博力威	1,556	90,372.48	0.08
231	688226	威腾电气	2,082	89,172.06	0.08
232	688676	金盘科技	1,035	87,602.40	0.08
233	688106	金宏气体	2,110	87,522.80	0.08
234	688308	欧科亿	459	83,450.79	0.07
235	688425	铁建重工	20,684	83,149.68	0.07
236	688165	埃夫特	4,065	82,926.00	0.07
237	688562	航天软件	5,503	82,875.18	0.07
238	688669	聚石化学	774	82,818.00	0.07
239	688083	中望软件	1,259	81,520.25	0.07
240	688359	三孚新科	405	80,368.20	0.07
241	688031	星环科技	677	77,976.86	0.07
242	688261	东微半导	732	76,808.76	0.07
243	688573	信宇人	4,293	76,071.96	0.07
244	688231	隆达股份	2,048	75,223.04	0.06
245	688726	拉普拉斯	1,418	74,941.30	0.06
246	688125	安达智能	458	74,883.00	0.06
247	688170	德龙激光	778	74,695.78	0.06
248	688379	华光新材	887	74,534.61	0.06
249	688221	前沿生物	3,323	74,435.20	0.06
250	688166	博瑞医药	2,117	74,116.17	0.06
251	688485	九州一轨	1,156	74,053.36	0.06
252	688118	普元信息	3,678	74,001.36	0.06
253	688320	禾川科技	1,775	73,573.75	0.06
254	688767	博拓生物	2,261	73,505.11	0.06
255	688070	纵横股份	1,968	73,465.44	0.06

256	688790	昂瑞微	580	73,341.00	0.06
257	688282	理工导航	1,260	73,332.00	0.06
258	688191	智洋创新	2,054	73,327.80	0.06
259	688160	步科股份	668	72,658.36	0.06
260	688786	悦安新材	1,576	72,622.08	0.06
261	688607	康众医疗	1,395	71,145.00	0.06
262	688583	思看科技	823	70,588.71	0.06
263	688139	海尔生物	2,639	69,722.38	0.06
264	688090	瑞松科技	654	69,618.30	0.06
265	688787	海天瑞声	517	69,510.65	0.06
266	688185	康希诺	1,358	69,244.42	0.06
267	688114	华大智造	1,351	69,009.08	0.06
268	688091	上海谊众	1,714	68,902.80	0.06
269	688273	麦澜德	1,773	68,686.02	0.06
270	688222	成都先导	2,138	68,651.18	0.06
271	688539	高华科技	2,118	67,521.84	0.06
272	688799	华纳药厂	1,503	67,439.61	0.06
273	688507	索辰科技	248	66,880.64	0.06
274	688667	菱电电控	500	66,825.00	0.06
275	688626	翔宇医疗	1,507	66,699.82	0.06
276	688133	泰坦科技	3,133	66,200.29	0.06
277	688050	爱博医疗	1,798	65,537.10	0.06
278	688323	瑞华泰	1,144	64,636.00	0.06
279	688656	浩欧博	665	64,352.05	0.06
280	688551	科威尔	907	63,734.89	0.05
281	688021	奥福科技	3,253	62,978.08	0.05
282	688168	安博通	854	58,712.50	0.05
283	688100	威胜信息	1,817	55,582.03	0.05
284	688065	凯赛生物	1,144	54,740.40	0.05
285	688318	财富趋势	747	53,268.57	0.05
286	688331	荣昌生物	399	51,973.74	0.04
287	688196	卓越新能	1,396	50,116.40	0.04
288	688116	天奈科技	1,309	50,003.80	0.04
289	688819	天能股份	2,249	49,927.80	0.04
290	688808	联讯仪器	31	49,114.23	0.04
291	688311	盟升电子	1,840	48,189.60	0.04
292	688660	电气风电	5,549	47,832.38	0.04
293	688408	中信博	1,358	43,659.70	0.04
294	688818	电科蓝天	479	33,597.06	0.03
295	688820	盛合晶微	178	25,185.22	0.02
296	688712	北芯生命	675	24,246.00	0.02
297	688785	恒运昌	44	20,378.60	0.02
298	688813	泰金新能	100	17,209.00	0.01

299	688635	长进光子	51	15,717.69	0.01
300	603407	长裕集团	81	5,950.26	0.01
301	688816	易思维	66	3,768.60	0.00
302	688777	中控技术	31	3,642.50	0.00
303	601112	振石股份	155	2,726.45	0.00
304	603435	嘉德利	56	2,615.76	0.00
305	688029	南微医学	20	1,436.00	0.00
306	688618	三旺通信	37	1,138.49	0.00
307	603284	林平发展	32	1,115.84	0.00
308	688582	芯动联科	16	1,040.00	0.00
309	688269	凯立新材	31	983.01	0.00
310	688089	ST 嘉必优	86	912.46	0.00
311	603293	埃泰克	22	746.46	0.00
312	688600	皖仪科技	20	665.60	0.00
313	688162	巨一科技	19	449.16	0.00
314	001366	播恩集团	36	390.24	0.00
315	688466	金科环境	30	384.90	0.00
316	688251	井松智能	12	307.56	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	688041	海光信息	4,164,836.06	2.27
2	688795	摩尔线程	1,767,732.79	0.96
3	688802	沐曦股份	1,703,785.16	0.93
4	688111	金山办公	1,347,031.28	0.73
5	688360	德马科技	1,262,031.88	0.69
6	688151	华强科技	1,255,871.35	0.68
7	300106	西部牧业	1,250,593.00	0.68
8	688256	寒武纪	1,199,163.66	0.65
9	688699	明微电子	1,153,346.53	0.63
10	688613	奥精医疗	1,139,209.06	0.62
11	688336	三生国健	1,132,773.12	0.62
12	688559	海目星	1,111,745.13	0.60
13	688002	睿创微纳	1,080,506.40	0.59
14	688709	成都华微	1,068,507.38	0.58
15	688118	普元信息	1,049,220.84	0.57
16	688653	康希通信	1,044,037.54	0.57
17	688328	深科达	1,027,156.34	0.56
18	688206	概伦电子	1,017,683.22	0.55
19	688682	霍莱沃	999,523.13	0.54
20	688365	光云科技	998,882.25	0.54

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	688041	海光信息	8,505,293.02	4.63
2	688256	寒武纪	4,658,929.63	2.53
3	688981	中芯国际	2,338,618.17	1.27
4	688008	澜起科技	2,178,257.69	1.18
5	688036	传音控股	2,065,120.48	1.12
6	688498	源杰科技	2,003,640.50	1.09
7	688082	盛美上海	1,931,407.82	1.05
8	688111	金山办公	1,827,024.80	0.99
9	688661	和林微纳	1,773,118.51	0.96
10	688322	奥比中光	1,742,648.04	0.95
11	688777	中控技术	1,630,971.67	0.89
12	688187	时代电气	1,620,248.71	0.88
13	688368	晶丰明源	1,594,496.75	0.87
14	688012	中微公司	1,574,561.94	0.86
15	688599	天合光能	1,508,957.64	0.82
16	688138	清溢光电	1,497,905.08	0.81
17	688702	盛科通信	1,482,215.44	0.81
18	688307	中润光学	1,463,498.87	0.80
19	688580	伟思医疗	1,417,920.39	0.77
20	688280	精进电动	1,382,951.09	0.75

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	262,344,909.96
卖出股票收入（成交）总额	369,913,650.79

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	指数基金	交易型开放式	华宝基金管理有限公司	27,852,500.00	23.97

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

华宝上证科创板综合增强策略 ETF 联接截止 2026 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，德马科技集团股份有限公司因：一、募集资金使用不规范；二、未对子公司进行有效管控，未按规定履行相应的审议程序和信息披露义务；三、部分收入确认单据规范性不足；四、内幕信息知情人登记管理不规范；五、部分独董履职时间未满足规定天数；于 2025 年 12 月 31 日收到上海证券交易所警示的处罚措施。

华宝上证科创板综合增强策略 ETF 联接截止 2026 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，德马科技集团股份有限公司因未履行信披义务，未依法履行其他职责，涉嫌违反相关法律法规；于 2026 年 01 月 01 日收到中国证券监督管理委员会浙江监管局警示，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他分析，认为上述处分不会对公司的投资价值构成实质性影响，因此本基金管理人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。

7.13.2 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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	184,456.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	184,456.99

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	688072	拓荆科技	665,600.00	0.57	重大事项停牌
2	688795	摩尔线程	499,581.72	0.43	新股锁定
3	688802	沐曦股份	409,818.37	0.35	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。

§ 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	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)
华宝上证 科创板综 合增强策 略 ETF 联 接 A	339	20,229.78	0.00	0.00	6,857,896.04	100.00
华宝上证 科创板综 合增强策 略 ETF 联 接 C	7,115	10,515.89	486,818.58	0.65	74,333,753.19	99.35
合计	7,454	10,957.67	486,818.58	0.60	81,191,649.23	99.40

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	华宝上证科创板综合增强策略 ETF 联接 A	2,426.39	0.0354
	华宝上证科创板综合增强策略 ETF 联接 C	0.00	0.0000
	合计	2,426.39	0.0030

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、 基金投资和研发部门 负责人持有本开放式 基金	华宝上证科创板综合增强策 略 ETF 联接 A	0
	华宝上证科创板综合增强策 略 ETF 联接 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有 本开放式基金	华宝上证科创板综合增强策 略 ETF 联接 A	0
	华宝上证科创板综合增强策 略 ETF 联接 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华宝上证科创板综合增强策略 ETF 联接 A	华宝上证科创板综合增强策略 ETF 联接 C
基金合同生效日	94,519,436.03	234,376,015.61

(2025 年 9 月 16 日) 基金份额总额		
本报告期期初基金份 额总额	27,164,682.26	150,618,638.37
本报告期基金总申购 份额	4,023,932.54	39,036,206.65
减：本报告期基金总 赎回份额	24,330,718.76	114,834,273.25
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	6,857,896.04	74,820,571.77

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

2026 年 6 月 23 日，根据托管人工作安排，聘任宋卓先生为平安银行股份有限公司资产托管部总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产和基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：2025 年 11 月 11 日起至本报告期末。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门无受到调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门相关从业人员无受到调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
江海证券	2	631,933,948.73	100.00	122,799.18	100.00	-

注：1. 基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

(1) 选择标准: 资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需，并能为本基金提供全面的信息服；研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；适当的地域分散化。

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

2. 本期交易单元未发生变化。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期内未使用证券公司交易单元进行其他证券投资。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华宝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	华宝上证科创板综合指数增强型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2026-01-22

3	华宝基金关于旗下部分基金新增宁波银行同业易管家平台为代销机构的公告	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	2026-02-04
4	华宝上证科创板综合指数增强型证券投资基金 2025 年年度报告	基金管理人网站	2026-03-31
5	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(“邮你同赢”平台)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	2026-04-01
6	华宝基金关于旗下部分基金新增中国人寿保险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	2026-04-03
7	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
8	华宝上证科创板综合指数增强型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2026-04-22
9	华宝基金关于旗下部分基金新增北京济安基金销售有限公司为代销机构的通知	基金管理人网站	2026-05-20
10	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
11	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
12	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
13	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招募说明书	基金管理人网站	2026-06-22
14	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(A类份额)基金产品资料概要(更新)	基金管理人网站	2026-06-22
15	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托管协议	基金管理人网站	2026-06-22
16	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(C类份额)基金产品资料概要(更新)	基金管理人网站	2026-06-22
17	关于华宝上证科创板综合指数增强型证券投资基金变更为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并修订基金合同等	基金管理人网站, 证券时报	2026-06-22

	法律文件的公告		
18	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基金合同	基金管理人网站	2026-06-22

§ 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 06 月 22 日发布关于华宝上证科创板综合指数增强型证券投资基金变更为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基金合同；

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招募说明书；

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