

宝盈中证 A500 指数增强型证券投资基金 2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 月 30 日

基金管理人：宝盈基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 10 月 27 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。
本报告期自 2026 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	宝盈中证 A500 指数增强
基金主代码	023514
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2025 年 12 月 9 日
报告期末基金份额总额	92,984,319.82 份
投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的跟踪误差基础上，通过数量化投资方法进行积极的组合管理与风险控制，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金为股票指数增强型基金，指数化投资部分将按照成份股在中证 A500 指数中的基准权重构建投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。指数增强投资部分主要通过公司内部的数量化选股模型，实行积极的配置策略，在跟踪标的指数的同时争取获得超越标的指数的收益。在正常市场情况下，本基金力争实现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%。 本基金的投资策略主要包括股票投资策略、债券投资策略、可转换债券（含可交换债券）投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生工具投资策略、参与融资业务策略、参与转融通证券出借业务策略、存托凭证投资策略等。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%

风险收益特征	本基金为股票型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。本基金为股票指数增强型基金，主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。 本基金可投资于港股通标的股票，会面临汇率风险和港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。	
基金管理人	宝盈基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	宝盈中证 A500 指数增强 A	宝盈中证 A500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	023514	023515
报告期末下属分级基金的份额总额	38,216,575.99 份	54,767,743.83 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2026 年 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日）	
	宝盈中证 A500 指数增强 A	宝盈中证 A500 指数增强 C
1. 本期已实现收益	-526,591.51	-940,983.79
2. 本期利润	-6,079,806.59	-11,320,381.02
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1473	-0.1393
4. 期末基金资产净值	38,642,175.08	55,286,420.96
5. 期末基金份额净值	1.0111	1.0095

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。

2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、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。

3.2 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

宝盈中证 A500 指数增强 A

阶段	净值增长率①	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	-12.77%	1.50%	-14.23%	1.43%	1.46%	0.07%
过去六个月	3.06%	1.45%	-2.62%	1.40%	5.68%	0.05%

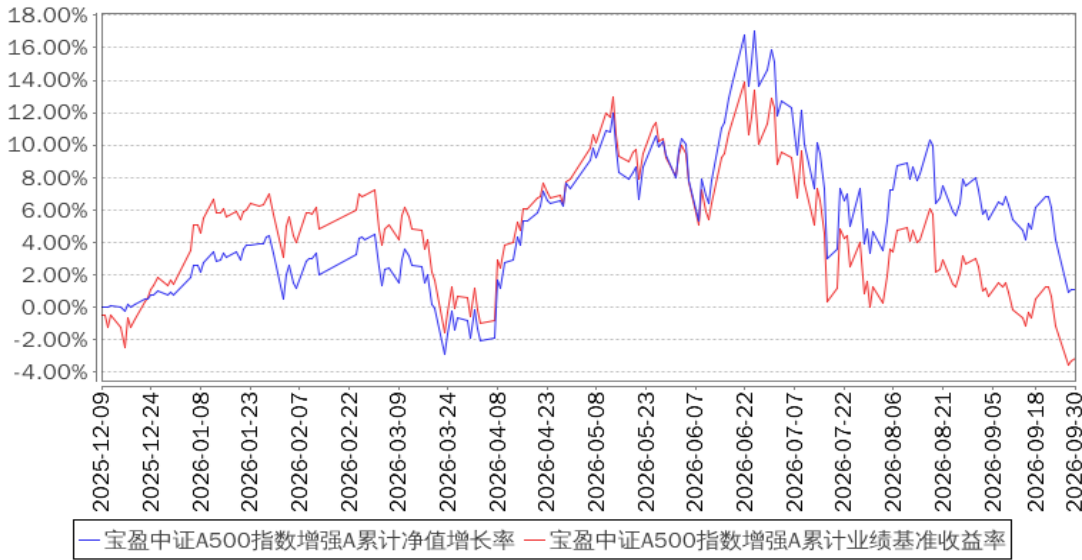
自基金合同生效起至今	1.11%	1.27%	-3.17%	1.27%	4.28%	0.00%
------------	-------	-------	--------	-------	-------	-------

宝盈中证 A500 指数增强 C

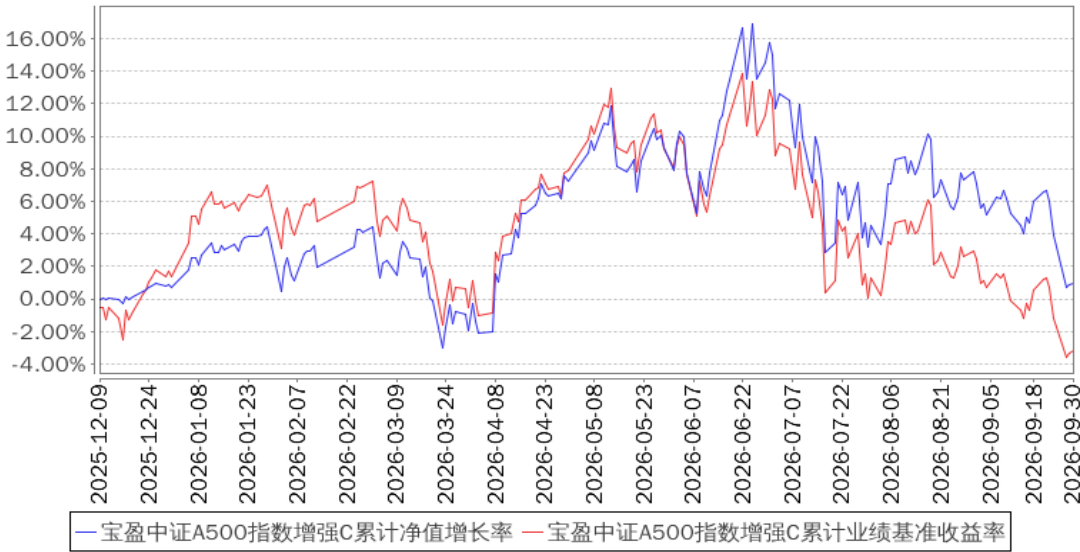
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-12.82%	1.50%	-14.23%	1.43%	1.41%	0.07%
过去六个月	2.96%	1.45%	-2.62%	1.40%	5.58%	0.05%
自基金合同生效起至今	0.95%	1.27%	-3.17%	1.27%	4.12%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

宝盈中证A500指数增强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



宝盈中证A500指数增强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、本基金合同于 2025 年 12 月 9 日生效，自合同生效日起至披露时点未满一年。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起的 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同中的相关约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
蔡丹	本基金、宝盈国证证券龙头指数型发起式证券投资基金、宝盈祥和 9 个月定期开放混合型证券投资基金、宝盈祥庆 9 个月持有期混合型证券投资基金、宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金、宝盈华证龙头红利 50 指数型发起式证券投资基金、宝盈新锐灵活配置混合型证券投资基金、宝盈纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金（QDII）、宝盈中证 A100 指数增强型证券投资基金、宝盈北证 50 成份指数型发起式证券投资基金、宝盈恒生科技指数型证券投资基金（QDII）、宝盈裕安增利 6 个月持有期债券型证券投资基金基金经理；量化投资部总经理	2025 年 12 月 9 日		15 年	蔡丹女士，CFA，中山大学概率论与数理统计硕士。曾任职于网易互动娱乐有限公司、广发证券股份有限公司，2011 年 9 月至 2017 年 7 月任职于长城证券股份有限公司，先后担任金融研究所金融工程研究员、资产管理部量化投资经理、执行董事。2017 年 7 月加入宝盈基金管理有限公司，中国国籍，证券投资基金从业人员资格。

阳璇女士，约翰霍普金斯大学数学与统计学硕士。2018 年 7 月加入宝盈基金管理有限公司，曾任研究员助理、量化研究员、基金经理助理，中国国籍，证券投资基金从业人员资格。	2026 年 2 月 28 日	-	7 年	阳之璇女士，约翰霍普金斯大学数学与统计学硕士。2018 年 7 月加入宝盈基金管理有限公司，曾任研究员助理、量化研究员、基金经理助理，中国国籍，证券投资基金从业人员资格。
--	-----------------	---	-----	---

4.1.1 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

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，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，无损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《宝盈基金管理有限公司公平交易制度》对本基金的日常交易行为进行监控，并定期制作公平交易分析报告，对不同投资组合的收益率、同向交易价差、反向交易价差作专项分析。报告结果表明，本基金在本报告期内的同向交易价差均在可合理解释范围之内；在本报告期内基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资活动中公平对待不同投资组合，公平交易制度执行情况良好，无损害基金持有人利益的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年三季度，A 股市场由二季度的“科技独舞”转向剧烈的风格再平衡。7 月，在韩国股市熔断引发的全球科技股高位回调这一外部冲击下，A 股前期高企的两融杠杆集中去化，叠加获利盘回吐，市场快速调整，沪指月内最大回撤逾 8%，创业板指单月跌逾两成。前期涨幅较大的 AI、半导体等方向深度回撤；8 月，在政策预期升温与超跌修复带动下，上证指数反弹 4.02%；9 月，受美联储重启加息、成交持续萎缩影响，市场缩量二次探底。整体看，三季度上证指数下跌 6.16% 收于 3,842.19 点，深证成指下跌 20.47%，创业板指下跌 27.80%，科创 50 下跌 30.70%，市场完

成了一轮由估值扩张向盈利验证、由极致成长向均衡配置的切换。

从量能来看，三季度沪深两市日均成交 22,590 亿元，仍处历史高位，但较二季度回落约 21%，且呈逐月退潮态势，7 月、8 月、9 月日均成交分别为 26,828 亿元、22,390 亿元和 18,148 亿元，9 月 29 日单日成交降至 14,092 亿元，创约 14 个月新低。海外方面，美联储 7 月按兵不动，9 月 16 日加息 25 个基点至 3.75%-4.00%，10 年期美债收益率一度升破 5%，全球流动性收紧压制成长股估值；但 10 月初美国 9 月非农数据意外走弱，市场对继续加息的预期明显降温。国内方面，7 月 30 日中央政治局会议释放政策加力信号，LPR 连续 16 个月保持不变，9 月制造业 PMI 回升至 50.1%，重返扩张区间，经济企稳信号有所增强。

从市场走势和行业表现来看，三季度 A 股主要指数普遍下跌，红利相对抗跌。上证指数下跌 6.16%，沪深 300 下跌 12.49%，上证 50 下跌 5.56%；深证成指、创业板指和科创 50 分别下跌 20.47%、27.80%和 30.70%；上证红利和中证红利分别上涨 14.58%和 9.38%。分行业来看，中信一级行业结构分化达到历史极端水平，银行、煤炭和农林牧渔涨幅居前，分别上涨 16.82%、15.49%和 14.64%；电子、通信和建材跌幅居前，分别下跌 31.91%、30.15%和 24.16%。

从风格表现来看，三季度市场从此前的极致成长转向防御与价值风格占优。以红利、银行为代表的高股息资产在 7 月市场调整中率先获得避险资金增配，并在 9 月银行股批量创历史新高后进一步强化；科技成长板块在 8 月出现超跌反弹，但未能收复 7 月失地，9 月重新走弱。整体看，三季度价值风格显著跑赢成长风格，大盘价值、红利类指数表现居前，创业板、科创板相关指数承压明显。资金配置由拥挤的 AI 赛道向低估值、高确定性的红利与顺周期方向迁移，成为本季度最鲜明的市场特征。

当前来看，经过三季度调整，A 股估值结构明显重构，科技板块估值大幅消化，红利等低估值方向估值仍处历史中低位。截至 2026 年 9 月 30 日，中证 A500 指数的 PE 为 15.58 倍，股息率为 2.39%，处于历史 67.94%分位数，基于股息率计算的股权风险溢价处于历史 94.59%分位数，估值与盈利的匹配度有所改善。

本基金致力于挖掘财务数据、一致预期数据、市场行情数据、市场情绪数据中蕴含的有效因子，构建多维度、多策略的选股体系。本基金通过对成份股内部有效因子的挖掘，在实现主要风险因子中性的基础上，严格控制与基准指数的偏离度，通过增强策略来增强产品收益。报告期内，本基金在跟踪中证 A500 指数成份股的基础上，通过多策略方式构建了增强组合。本季度本基金 A 份额期间超额收益为 1.47%，年化跟踪误差为 3.00%。我们将继续努力尽责地做好本基金的管理工作，力争为投资者谋取较好的回报。

展望四季度，我们认为市场正处于“外部约束边际缓解、国内政策持续加力、盈利验证进入

关键窗口”的交织期。海外方面，美国 9 月非农数据走弱使美联储继续加息的概率下降，美债利率高位回落有望缓解全球成长股的估值压力；国内方面，7 月政治局会议后存量政策加快落地，四季度财政支出提速以及降准降息预期有望对经济和市场形成支撑，9 月 PMI 重回扩张区间也表明稳增长政策效果正在显现。与此同时，三季报业绩兑现情况将成为市场方向的重要决断点，科技成长板块在估值大幅消化后需要盈利验证，红利、银行等低估值高股息资产仍具备防御和配置价值。本基金将继续优化组合结构，控制组合偏离和回撤，力争在有效控制风险的基础上为投资者获取稳健回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末宝盈中证 A500 指数增强 A 的基金份额净值为 1.0111 元，本报告期基金份额净值增长率为-12.77%；截至本报告期末宝盈中证 A500 指数增强 C 的基金份额净值为 1.0095 元，本报告期基金份额净值增长率为-12.82%。同期业绩比较基准收益率为-14.23%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	89,062,771.06	92.28
	其中：股票	89,062,771.06	92.28
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	4,053,482.74	4.20
	其中：债券	4,053,482.74	4.20
	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	3,277,199.02	3.40
8	其他资产	120,113.36	0.12
9	合计	96,513,566.18	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	100,488.00	0.11
B	采矿业	4,891,063.00	5.21
C	制造业	51,207,176.56	54.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,759,717.00	1.87
E	建筑业	1,056,026.00	1.12
F	批发和零售业	957,681.80	1.02
G	交通运输、仓储和邮政业	2,549,725.00	2.71
H	住宿和餐饮业	73,931.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,801,690.94	2.98
J	金融业	9,893,599.00	10.53
K	房地产业	321,216.00	0.34
L	租赁和商务服务业	332,331.00	0.35
M	科学研究和技术服务业	1,769,254.00	1.88
N	水利、环境和公共设施管理业	404,895.00	0.43
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	84,014.00	0.09
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	18,222.00	0.02
	合计	78,221,030.30	83.28

5.2.2 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	15,288.15	0.02
C	制造业	7,968,348.99	8.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	366,796.14	0.39
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	388,552.20	0.41
G	交通运输、仓储和邮政业	2,832.00	0.00
H	住宿和餐饮业	2,034.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	772,174.28	0.82
J	金融业	859,549.00	0.92
K	房地产业	274,391.00	0.29
L	租赁和商务服务业	1,510.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	4,770.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	175,324.00	0.19

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	2,863.00	0.00
Q	卫生和社会工作	3,198.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	4,110.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	10,841,740.76	11.54

5.2.3 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股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	3,700	2,991,228.00	3.18
2	300750	宁德时代	9,000	2,619,990.00	2.79
3	600519	贵州茅台	1,600	2,013,792.00	2.14
4	603259	药明康德	10,000	1,673,400.00	1.78
5	601318	中国平安	30,700	1,636,003.00	1.74
6	300502	新易盛	3,760	1,462,640.00	1.56
7	601398	工商银行	158,700	1,314,036.00	1.40
8	601899	紫金矿业	40,800	1,215,432.00	1.29
9	601328	交通银行	137,000	1,061,750.00	1.13
10	000333	美的集团	13,000	1,041,300.00	1.11

5.3.2 报告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前五名股票投资明细

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	688825	长鑫科技	20,539	793,832.35	0.85
2	601869	长飞光纤	800	328,928.00	0.35
3	601138	工业富联	5,000	291,000.00	0.31
4	301377	鼎泰高科	800	272,800.00	0.29
5	301200	大族数控	1,200	269,748.00	0.29

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	4,053,482.74	4.32
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,053,482.74	4.32

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019792	25 国债 19	40,000	4,053,482.74	4.32

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值和流动性管理为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险和流动性风险，改善组合的风险收益特性。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控，在追求基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的中长期稳定增值。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本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

本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内除工商银行、交通银行的发行主体外未受到公开谴责、处罚。

2025 年 12 月 10 日，根据银罚决字〔2025〕110 号显示，中国工商银行股份有限公司因 1. 违反金融统计相关规定；2. 违反账户管理规定；3. 违反清算管理规定；4. 违反特约商户实名制管理规定；5. 违反反假货币业务管理规定；6. 违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定；7. 未按规定履行客户身份识别义务；8. 未按规定保存客户身份资料和交易记录；9. 未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告；10. 与身份不明的客户进行交易等行为被中国人民银行处以警告，没收违法所得 434.57 万元，罚款 3961.5 万元的处罚。

2025 年 12 月 18 日，根据京汇罚〔2025〕49 号显示，中国工商银行股份有限公司因未经批准办理跨境资产转让业务；办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查；违反规定办理资本项目资金收付；违反规定办理结汇、售汇业务；未按照规定进行国际收支统计申报等行为被国家外汇管理局北京市分局处以警告、罚没违法所得 1142.59 万元的处罚。

2026 年 6 月 5 日，根据国家金融监督管理总局行政处罚信息公示列表显示，中国工商银行股份有限公司因重要信息系统投产变更风险管控不到位、未按规定报告重要信息系统突发事件等行被国家金融监督管理总局处以罚款 105 万元的处罚。

2025 年 12 月 10 日，根据银罚决字〔2025〕96 号显示，交通银行股份有限公司因 1. 违反账户管理规定；2. 违反清算管理规定；3. 违反特约商户实名制管理规定；4. 违反反假货币业务管理规定；5. 占压财政存款或者资金；6. 违反国库科目设置和使用规定；7. 违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定；8. 未按规定履行客户身份识别义务；9. 未按规定保存客户身份资料和交易记录；10. 未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告；11. 与身份不明的客户进行交易或者为客户开立匿名账户、假名账户等行为被中国人民银行处以警告，没收违法所得 23.98 万元，罚款

6783.43 万元的处罚。

2026 年 6 月 5 日，根据国家金融监督管理总局行政处罚信息公示列表显示，交通银行股份有限公司因灾备恢复能力建设不足、重要信息系统应急管理不足等行为被国家金融监督管理总局处以罚款 80 万元的处罚。

我们认为相关处罚措施对工商银行、交通银行的正常经营会产生一定影响，但影响可控。本基金的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

5.11.2 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

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	—
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	120,113.36
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	120,113.36

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告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的情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688825	长鑫科技	793,832.35	0.85	新股流通受限

5.11.6 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，分项与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	宝盈中证 A500 指数增强 A	宝盈中证 A500 指数增强 C
报告期期初基金份额总额	43,662,932.56	82,466,613.28
报告期期间基金总申购份额	1,133,462.92	19,255,373.47
减:报告期期间基金总赎回份额	6,579,819.49	46,954,242.92
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	38,216,575.99	54,767,743.83

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

中国证监会准予宝盈中证 A500 指数增强型证券投资基金注册的文件。

《宝盈中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》。

《宝盈中证 A500 指数增强型证券投资基金托管协议》。

法律意见书。

基金管理人业务资格批件、营业执照。

基金托管人业务资格批件、营业执照。

中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

基金管理人办公地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 10 层

基金托管人办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

9.3 查阅方式

上述备查文件文本分别存放在基金管理人和基金托管人的办公场所，在办公时间内基金持有人可免费查阅。

宝盈基金管理有限公司

2026 年 10 月 27 日