

# 宝盈中证 A100 指数增强型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告

2026 年 3 月 31 日

基金管理人：宝盈基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 4 月 22 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 4 月 21 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 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 宝盈中证 A100 指数增强   |
| 基金主代码      | 213010   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2010 年 2 月 8 日   |
| 报告期末基金份额总额 | 117,420,286.35 份   |
| 投资目标       | 在基金合同规定的范围内，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，结合增强收益的主动投资，力争取得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%、年跟踪误差不超过 7.75%、基金总体投资业绩超越中证 A100 指数的表现。                           |
| 投资策略       | 本基金为增强型指数基金，对指数投资部分采用完全复制法，按照成份股在中证 A100 指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。本基金对主动投资部分实行双向积极配置策略。<br>本基金的投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、金融衍生产品投资策略。 |
| 业绩比较基准     | 中证 A100 指数×95%+活期存款利率（税后）×5%   |
| 风险收益特征     | 本基金投资于中证 A100 指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产的 80%，预期风险收益高于混合型基金、债券基金和货币市场基金，属于较高风险收益预期的证券投资基金产品。  |
| 基金管理人      | 宝盈基金管理有限公司   |

|                 |                  |                  |
|-----------------|------------------|------------------|
| 基金托管人           | 中国建设银行股份有限公司     |                  |
| 下属分级基金的基金简称     | 宝盈中证 A100 指数增强 A | 宝盈中证 A100 指数增强 C |
| 下属分级基金的交易代码     | 213010           | 007580           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 83,329,508.30 份  | 34,090,778.05 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 1 月 1 日-2026 年 3 月 31 日） |                  |
|-----------------|-------------------------------------|------------------|
|                 | 宝盈中证 A100 指数增强 A                    | 宝盈中证 A100 指数增强 C |
| 1. 本期已实现收益      | 13,539,981.65                       | 8,322,746.54     |
| 2. 本期利润         | -3,164,154.11                       | 1,494,577.37     |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0342                             | 0.0267           |
| 4. 期末基金资产净值     | 173,229,609.44                      | 68,056,039.71    |
| 5. 期末基金份额净值     | 2.079                               | 1.996            |

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 A100 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 | -2.81%  | 1.00%     | -3.30%     | 1.00%         | 0.49%   | 0.00%  |
| 过去六个月 | -1.98%  | 0.99%     | -3.49%     | 0.99%         | 1.51%   | 0.00%  |
| 过去一年  | 19.35%  | 0.97%     | 15.35%     | 0.97%         | 4.00%   | 0.00%  |
| 过去三年  | 23.68%  | 1.05%     | 10.28%     | 1.05%         | 13.40%  | 0.00%  |
| 过去五年  | 6.04%   | 1.08%     | -15.86%    | 1.09%         | 21.90%  | -0.01% |
| 自基金合同 | 152.15% | 1.28%     | 42.67%     | 1.29%         | 109.48% | -0.01% |

|       |  |  |  |  |  |  |
|-------|--|--|--|--|--|--|
| 生效起至今 |  |  |  |  |  |  |
|-------|--|--|--|--|--|--|

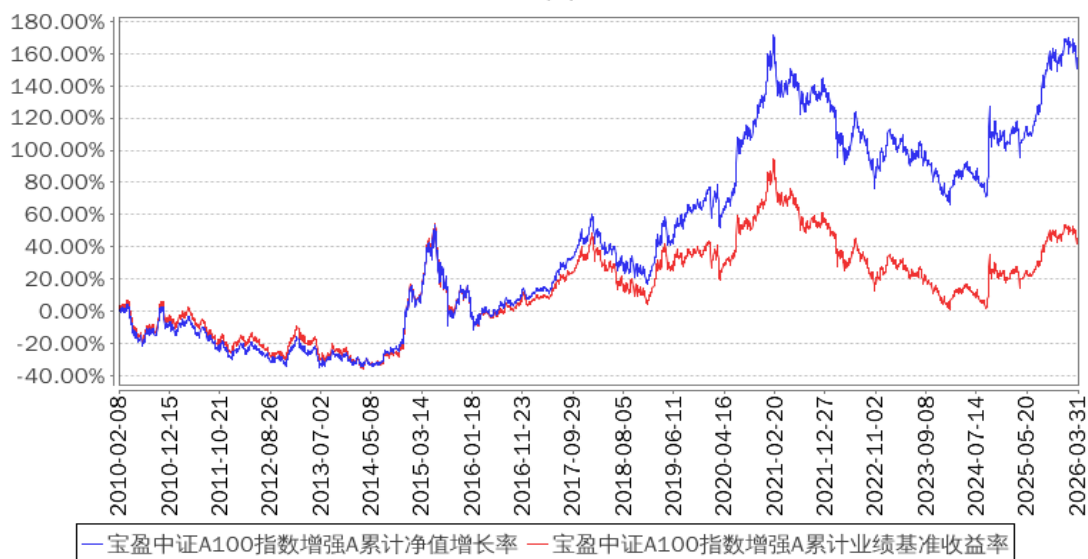
宝盈中证 A100 指数增强 C

| 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      | -2.87% | 0.99%     | -3.30%     | 1.00%         | 0.43%  | -0.01% |
| 过去六个月      | -2.11% | 0.99%     | -3.49%     | 0.99%         | 1.38%  | 0.00%  |
| 过去一年       | 18.95% | 0.97%     | 15.35%     | 0.97%         | 3.60%  | 0.00%  |
| 过去三年       | 21.56% | 1.05%     | 10.28%     | 1.05%         | 11.28% | 0.00%  |
| 过去五年       | 2.53%  | 1.08%     | -15.86%    | 1.09%         | 18.39% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 52.69% | 1.12%     | 5.94%      | 1.13%         | 46.75% | -0.01% |

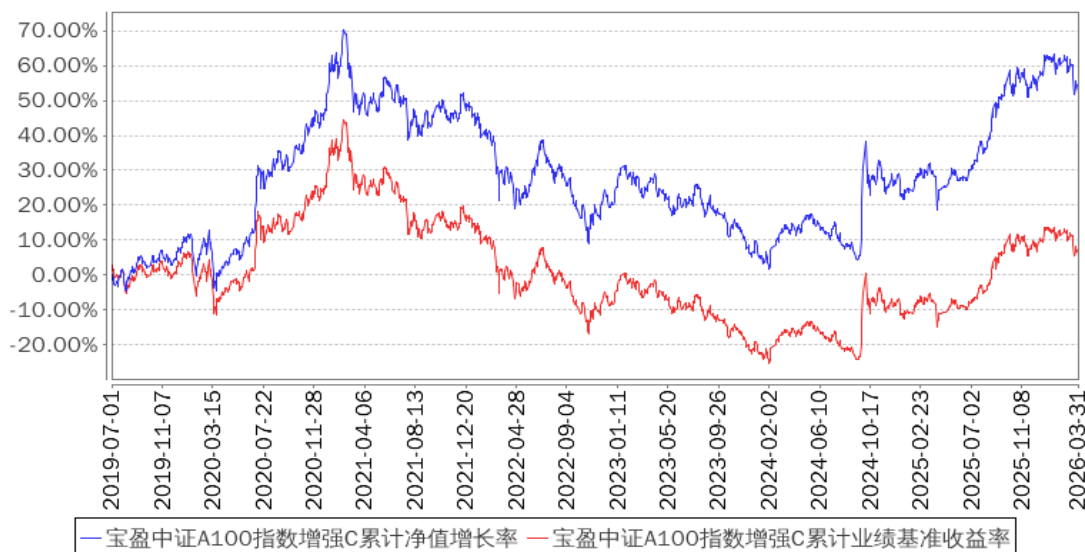
注：本基金于 2019 年 7 月 1 日起增加收取销售服务费的 C 类收费模式，其对应的基金份额简称“宝盈中证 A100 指数增强 C”。

### 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A100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A100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：本基金于 2019 年 7 月 1 日起增加收取销售服务费的 C 类收费模式，其对应的基金份额简称“宝盈中证 A100 指数增强 C”。

## §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      |      | 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、宝盈祥裕增强回报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)、宝盈北证 50 成份指数型发起式证券投资基金、宝盈中证 A500 指数增强型证券投资、宝盈恒生科技指数型证券投资基金 (QDII) 基金经理；量化投资部总经理 | 2024 年 10 月 28 日 | -    | 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。 |

#### 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合规守信情况的说明

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

今年 2 月 28 日美伊冲突爆发以来，全球市场出现了不同程度波动，大类资产整体呈现高波动运行特征，宏观主线交织反转、预期快速切换。一方面，美伊局势突发升级并持续拉锯，国际油价大幅上行，推升全球通胀预期，引发资产价格剧烈震荡；另一方面，美联储降息周期延后担忧，叠加 AI 技术对传统行业的颠覆预期扩散，对成长类权益及黄金定价形成显著扰动。从上证指数的表现来看，一季度呈现高位震荡格局，年初以来延续去年 12 月下旬上涨走势，3 月 3 日盘中触及 4197.23 点，之后在外围扰动下震荡走弱，季末收于 3891.86 点，季度下跌 1.94%，表现出明显的韧性。从国内来看，一是能源自给率高，2026 年我国能源自给率预计提升至 84.6%；二是经济基本面向好成为“压舱石”，2026 年开年经济数据验证复苏韧性，出口数据大超市场预期，工业生产在高技术制造业引领下加快增长，消费受服务消费回暖与价格修复支撑温和复苏；三是流动性充裕，货币政策适度宽松，前两月社会融资规模同比多增 3162 亿元，监管部门持续推动中长期资

金入市，构建“长钱长投”的生态。

本季度两市成交延续活跃态势，日均成交金额达 2.56 万亿，远超上季度的 1.95 万亿，处于历史最高水平。海外方面，油价上行引发的二次通胀风险，美联储年内降息预期进一步弱化，甚至开始定价加息以应对通胀反弹，对前期估值处于相对高位的美股形成压制。本季度美元相对人民币贬值 1.16%，季末美元兑人民币即期汇率为 6.9801，位于 2015 年以来 59.34%的分位数。

从市场走势来看，本季度多数指数收跌，大盘表现弱于中小盘：中证 500 上涨 2.03%，中证 2000 上涨 1.22%，创业板指下跌 0.57%，科创综指下跌 1.11%，中证 A500 下跌 2.06%，中证 800 下跌 2.28%，中证 A100 下跌 3.49%，沪深 300 和上证 50 分别下跌 3.89%和 6.76%。分行业来看，中信一级行业仅有 10 个行业上涨，涨幅前三的行业：煤炭（上涨 17.56%）、石油石化（上涨 12.16%）和电力及公用事业（上涨 8%）；跌幅居前的三个行业：综合金融（下跌 15.77%）、非银金融（下跌 14.82%）和消费者服务（下跌 12.84%）。

从价值成长风格来看，本季度风格差异不大，国证成长下跌 0.12%，国证价值下跌 0.84%。从规模指数来看，中盘表现最好，其中，中盘价值和中盘成长分别上涨 7.5%和 5.73%，好于小盘成长和小盘价值，而大盘价值和大盘成长表现最弱，分别下跌 4.53%和 2.77%。

当前来看，在经历 3 月份回调后，主要指数估值均有所回落，当前 A 股主要指数的 PE 估值水平处于历史 58%左右分位数水平，从基于股息率计算的股权风险溢价来看，大多处于历史 83%左右分位数水平。截至 2026/3/31，中证 A100 指数的 PE 为 17.06 倍，股息率为 2.71%，股息率处于历史 57.33%的分位数水平。

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。此外，本基金还积极参与新股研究，甄别新股参与价值，对于有价值的网下新股申购，本基金积极参与，以期通过打新来提供稳定的增强收益。

报告期内，本基金在复制中证 A100 指数成份股的基础上，配置了部分增强策略，同时积极甄选个股参与网下新股申购。2026 年一季度本基金 A 份额期间超额收益为 0.49%，年化跟踪误差为 0.88%。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。

展望下个季度，我们认为二季度经济有望延续复苏态势，为 A 股慢牛奠定基础。地缘政治方面，我们认为市场对美伊冲突反应可能逐渐钝化。4 月进入财报季，随着业绩披露，财报季不确定性会逐步消除。我们认为当前仍然存在多项有利因素支撑市场稳健运行。一是经济韧性强，投资上，“十五五”开局之年，各方面抢抓机遇，推动重大工程开工建设，带动投资回升。二是政

策稳预期，2026 年《政府工作报告》提出持续深化资本市场投融资综合改革，进一步健全中长期资金入市机制，完善投资者保护制度。三是不确定因素逐步被市场定价，如中东地缘局势缓和，全球通胀压力将大幅缓解，叠加人民币汇率走强，中国资产吸引力提升，当前国内无风险收益处于低位，我们预计存款搬家还会持续，资金入市为 A 股提供更多的增量资金，A 股有望延续结构性行情。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末宝盈中证 A100 指数增强 A 的基金份额净值为 2.079 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.81%；截至本报告期末宝盈中证 A100 指数增强 C 的基金份额净值为 1.996 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.87%。同期业绩比较基准收益率为-3.30%。

#### 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              | 228,212,538.33 | 94.22        |
|    | 其中：股票             | 228,212,538.33 | 94.22        |
| 2  | 基金投资              | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 8,286,275.43   | 3.42         |
|    | 其中：债券             | 8,286,275.43   | 3.42         |
|    | 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      | 4,780,197.96   | 1.97         |
| 8  | 其他资产              | 930,433.38     | 0.38         |
| 9  | 合计                | 242,209,445.10 | 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 | 1,592,904.90 | 0.66         |

|   |                  |                |       |
|---|------------------|----------------|-------|
| B | 采矿业              | 18,966,545.00  | 7.86  |
| C | 制造业              | 140,485,692.12 | 58.22 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 5,876,011.00   | 2.44  |
| E | 建筑业              | 3,184,984.40   | 1.32  |
| F | 批发和零售业           | -              | -     |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | 5,996,615.90   | 2.49  |
| H | 住宿和餐饮业           | -              | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 11,853,374.27  | 4.91  |
| J | 金融业              | 24,171,048.50  | 10.02 |
| K | 房地产业             | 1,280,395.00   | 0.53  |
| L | 租赁和商务服务业         | 1,713,155.60   | 0.71  |
| M | 科学研究和技术服务业       | 4,029,163.20   | 1.67  |
| 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          | 570,200.58     | 0.24  |
| R | 文化、体育和娱乐业        | -              | -     |
| S | 综合               | -              | -     |
|   | 合计               | 219,720,090.47 | 91.06 |

### 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         | 154,618.00   | 0.06         |
| B  | 采矿业              | 410,889.07   | 0.17         |
| C  | 制造业              | 4,941,677.97 | 2.05         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 459,423.00   | 0.19         |
| E  | 建筑业              | 246,892.00   | 0.10         |
| F  | 批发和零售业           | 11,165.48    | 0.00         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 446,300.66   | 0.18         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -            | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 475,916.30   | 0.20         |
| J  | 金融业              | 1,092,600.74 | 0.45         |
| K  | 房地产业             | 91,750.00    | 0.04         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 130,694.00   | 0.05         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 17,319.64    | 0.01         |
| 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          | 5,224.00     | 0.00         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 2,669.00     | 0.00         |

|   |    |              |      |
|---|----|--------------|------|
| S | 综合 | 5,308.00     | 0.00 |
|   | 合计 | 8,492,447.86 | 3.52 |

### 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  | 300750 | 宁德时代 | 42,080  | 16,903,536.00 | 7.01         |
| 2  | 600519 | 贵州茅台 | 9,400   | 13,630,000.00 | 5.65         |
| 3  | 300308 | 中际旭创 | 17,380  | 9,896,345.80  | 4.10         |
| 4  | 601318 | 中国平安 | 162,825 | 9,245,203.50  | 3.83         |
| 5  | 601899 | 紫金矿业 | 263,500 | 8,621,720.00  | 3.57         |
| 6  | 600036 | 招商银行 | 187,200 | 7,360,704.00  | 3.05         |
| 7  | 000333 | 美的集团 | 74,450  | 5,684,257.50  | 2.36         |
| 8  | 600900 | 长江电力 | 182,400 | 4,932,096.00  | 2.04         |
| 9  | 002594 | 比亚迪  | 39,800  | 4,188,950.00  | 1.74         |
| 10 | 002475 | 立讯精密 | 84,288  | 4,152,026.88  | 1.72         |

#### 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  | 601998 | 中信银行 | 35,000 | 290,500.00 | 0.12         |
| 2  | 600930 | 华电新能 | 41,800 | 262,504.00 | 0.11         |
| 3  | 600104 | 上汽集团 | 17,800 | 259,702.00 | 0.11         |
| 4  | 601872 | 招商轮船 | 15,600 | 255,216.00 | 0.11         |
| 5  | 600600 | 青岛啤酒 | 3,900  | 241,254.00 | 0.10         |

### 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      | 8,286,275.43 | 3.43         |
| 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 | 8,286,275.43 | 3.43 |

### 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  | 019773 | 25 国债 08 | 40,000 | 4,053,098.08 | 1.68         |
| 2  | 019785 | 25 国债 13 | 20,000 | 2,019,019.18 | 0.84         |
| 3  | 019792 | 25 国债 19 | 17,000 | 1,712,838.03 | 0.71         |
| 4  | 019827 | 26 国债 01 | 5,000  | 501,320.14   | 0.21         |

### 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

本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与股指期货交易。

### 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

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。

#### 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未受到公开谴责、处罚。

### 5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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   | 106,679.36 |
| 2  | 应收证券清算款 | 737,939.59 |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | -          |
| 5  | 应收申购款   | 85,814.43  |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 其他      | -          |
| 8  | 合计      | 930,433.38 |

### 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

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

### 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 A100 指数增强 A | 宝盈中证 A100 指数增强 C |
|----|------------------|------------------|
|----|------------------|------------------|

|                           |                |                |
|---------------------------|----------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 114,241,909.50 | 104,698,852.75 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 6,785,711.35   | 15,909,243.17  |
| 减:报告期期间基金总赎回份额            | 37,698,112.55  | 86,517,317.87  |
| 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               | 83,329,508.30  | 34,090,778.05  |

## §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

中国证监会批准宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金设立的文件。

根据《关于宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金变更基金名称、调低销售服务费率并修订法律文件的公告》将宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金名称变更为宝盈中证 A100 指数增强型证券投资基金。

《宝盈中证 A100 指数增强型证券投资基金基金合同》。

《宝盈中证 A100 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：广东省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：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

## 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 4 月 22 日