

融通中证 A500 指数增强型证券投资基金

2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：融通基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 28 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据融通中证 A500 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同规定，于 2025 年 8 月 26 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 2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	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	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	42
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	47
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 本基金投资股指期货的投资政策	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 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	48
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	48
§ 9 开放式基金份额变动	49
§ 10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
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	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4 基金投资策略的改变	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	49
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8 其他重大事件	51
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	52
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	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	52
§ 12 备查文件目录	52
12.1 备查文件目录	52
12.2 存放地点	52
12.3 查阅方式	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	融通中证 A500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	融通中证 A500 指数增强	
基金主代码	022820	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 3 月 18 日	
基金管理人	融通基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	111,408,245.18 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	融通中证 A500 指数增强 A	融通中证 A500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	022820	022821
报告期末下属分级基金的份额总额	31,916,669.93 份	79,491,575.25 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，力争在对标的指数进行有效跟踪的基础上，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	本基金以中证 A500 指数为标的指数，采用“指数化投资为主、增强策略为辅”的投资策略，一方面严格控制投资组合的跟踪误差，避免大幅偏离标的指数，另一方面在跟踪标的指数的同时，力争获得超越标的指数的收益。在正常市场情况下，本基金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%，年跟踪误差不超过 7.75%。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率 \times 95% + 人民币活期存款利率（税后） \times 5%
风险收益特征	本基金为股票型指数增强基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。本基金可投资港股通标的股票，会面临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。

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	融通基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	涂卫东
	联系电话	(0755) 26948666
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com
客户服务电话	400-883-8088、(0755) 26948088	95559
传真	(0755) 26935005	(021) 62701216
注册地址	深圳市南山区粤海街道海珠社区海德三道 1066 号深创投广场 41 层、42 层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址	深圳市南山区粤海街道海珠社区海德三道 1066 号深创投广场 41 层、42 层	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码	518054	200336
法定代表人	张威	任德奇

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
----------------	------

登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.rtfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人处、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	融通基金管理有限公司	深圳市南山区粤海街道海珠社区海德三道 1066 号深创投广场 41 层、42 层

§ 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	2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	融通中证 A500 指数增强 A	融通中证 A500 指数增强 C
本期已实现收益	371,557.51	1,119,577.63
本期利润	621,342.19	1,981,563.11
加权平均基金份额本期利润	0.0098	0.0076
本期加权平均净值利润率	0.98%	0.76%
本期基金份额净值增长率	1.49%	1.42%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	276,150.29	636,290.62
期末可供分配基金份额利润	0.0087	0.0080
期末基金资产净值	32,391,677.47	80,622,743.53
期末基金份额净值	1.0149	1.0142
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	1.49%	1.42%

注：1、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。

2、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，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润÷期末基金份额总额。其中期末可供分配利润：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果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（已实现部分扣除未实现部分）。

4、本基金的基金合同于 2025 年 3 月 18 日生效，本报告的统计期间为 2025 年 3 月 18 日至本报告期末。

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

融通中证 A500 指数增强 A

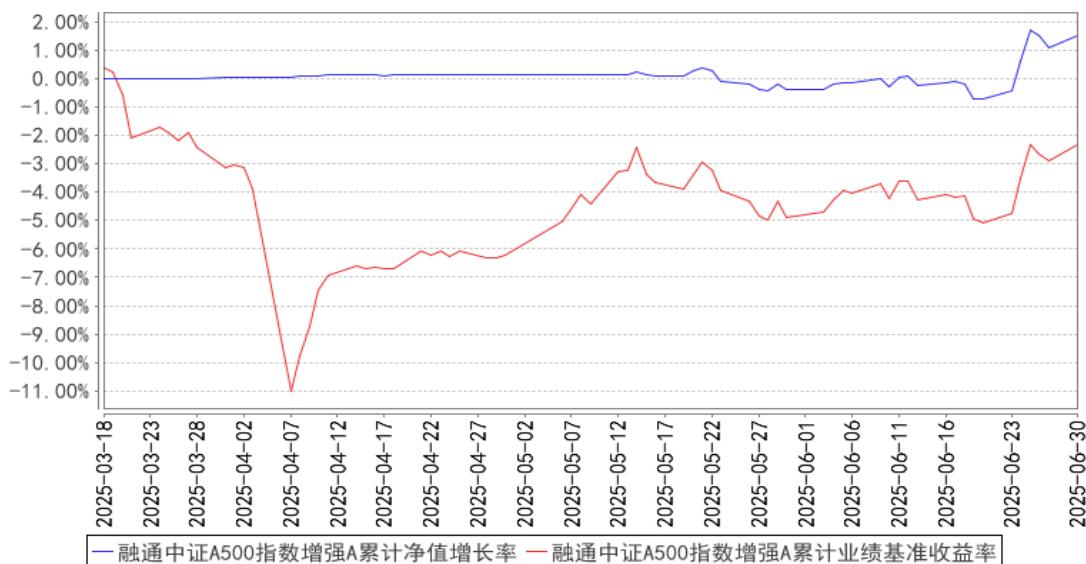
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.90%	0.40%	2.68%	0.57%	-0.78%	-0.17%
过去三个月	1.47%	0.25%	0.83%	1.14%	0.64%	-0.89%
自基金合同生效起至今	1.49%	0.23%	-2.33%	1.08%	3.82%	-0.85%

融通中证 A500 指数增强 C

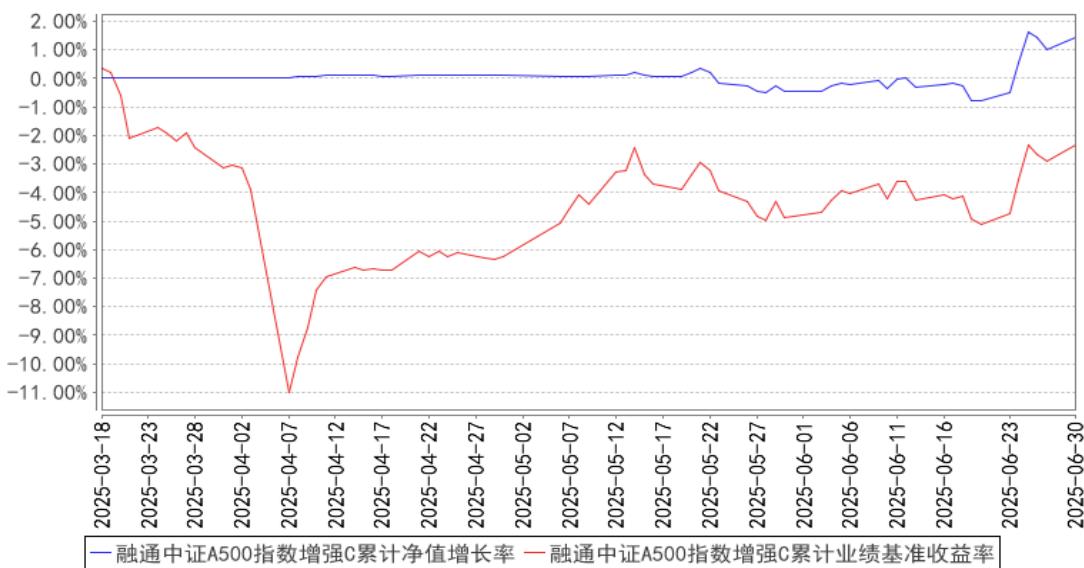
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.87%	0.40%	2.68%	0.57%	-0.81%	-0.17%
过去三个月	1.41%	0.25%	0.83%	1.14%	0.58%	-0.89%
自基金合同生效起至今	1.42%	0.23%	-2.33%	1.08%	3.75%	-0.85%

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

融通中证 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



融通中证 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、本基金基金合同生效日为 2025 年 3 月 18 日，至报告期末合同生效未满 1 年；

2、本基金的建仓期为自合同生效日起 6 个月，截至报告期末，本基金尚在建仓期内。

3.3 其他指标

无。

§ 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

融通基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经中国证监会证监基字[2001]8号文批准，于2001年5月22日成立，公司注册资本12500万元人民币。本公司的股东及其出资比例为：诚通证券股份有限公司60%、日兴资产管理有限公司（Nikko Asset ManagementCo., Ltd.）40%。本基金管理人拥有公募基金管理资格、特定客户（专户）资产管理资格、合格境内机构投资者资格（QDII）、保险资产受托管理资格、人民币合格境内机构投资者（RQDII）资格、合格境内投资企业（QDIE）资格，产品线完备，涵盖主动权益类基金、被动投资类基金、债券基金、货币基金、混合基金、QDII基金等。

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		
何天翔	本基金的 基 金 经 理、 指 数	2025 年 3 月 18 日	-	17 年	何天翔先生，厦门大学经济学硕士，17 年证券、基金行业从业经历，具有基金从业资格。2008 年 7 月至 2010 年 3 月就职于

	与量化投资部总经理				华泰联合证券有限责任公司任金融工程分析师。2010 年 3 月加入融通基金管理有限公司，历任金融工程研究员、专户投资经理、指数与量化投资部总监、融通中证大农业指数证券投资基金（LOF）基金经理、融通国企改革新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金经理、融通中证军工指数分级证券投资基金基金经理、融通中证精准医疗主题指数证券投资基金（LOF）基金经理、融通通瑞债券型证券投资基金基金经理、融通创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理，现任指数与量化投资部总经理、融通深证 100 指数证券投资基金基金经理、融通新趋势灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通中证人工智能主题指数证券投资基金（LOF）基金经理、融通中证云计算与大数据主题指数证券投资基金（LOF）基金经理、融通中证诚通央企科技创新交易型开放式指数证券投资基金基金经理、融通中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理、融通深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、融通中证诚通央企科技创新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。
熊俊杰	本基金的基金经理	2025 年 3 月 18 日	-	7 年	熊俊杰先生，理学硕士，7 年证券基金行业从业经历，具有基金从业资格。2017 年 10 月至 2018 年 11 月在招商期货有限公司资产管理部工作，2018 年 12 月至 2023 年 7 月在新华基金管理股份有限公司先后担任研究员、投资经理、基金经理助理，2023 年 7 月加入融通基金管理有限公司。现任融通巨潮 100 指数证券投资基金（LOF）基金经理、融通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、融通中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理、融通深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

注：任免日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写；证券从业年限以从事证券、基金业务相关工作的时间为计算标准。

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

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规和本基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为，本基金投资组合符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

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

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合的原则，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。

本基金管理人对报告期内不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内、10 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行了分析，各投资组合的同向交易价差均处于合理范围之内。

报告期内，本基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发生异常交易。

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

在严格遵守基金合同的前提下实现持有人利益的最大化是本基金管理的核心思想，并将此原则贯彻于基金的运作之中。本基金运用量化投资策略进行指数增强和风险管理，在控制基金相对中证 A500 指数增强基金基准的跟踪误差下，力求最终为投资者带来超越基金基准的收益。

回顾 2025 年上半年，中证 A500 上涨 0.47%，沪深 300 上涨 0.03%，中证 500 上涨 3.31%，中证 1000 上涨 6.69%，创业板指上涨 0.52%，总体依旧呈现小盘股占优的行情，市场日均成交额约 1.4 万亿，相较 2024 年下半年有所放量，交投情绪依旧火热。在指数增强方面，本基金总体依旧采取多因子多策略的量化选股增强模型进行投资配置，构建不同风格属性和相关性较低的 Alpha 子策略来搭建多策略模型框架，模型框架运行平稳，2025 年上半年 Alpha 模型中加入了一些新的偏高频的选股因子，进一步增强模型的 Alpha 获取能力，从风格暴露来看，在风格约束的前提下，近期模型总体权重变化不大，相对而言，在价值和量价两大类因子上的权重有所提升。风险管理方面，本基金依旧采取多维度多层次的更精细化的风险约束，风险约束下沉至行业，也会进行风格分域的风险约束，使得风险约束更合理更有效，因子择时模型 2025 年上半年并未触发因子择时信号，此外，2025 年上半年在现有的框架上再加入组合整体层面的 Barra 风险因子约束，使得模型的风险约束的维度更多元。截止到 2025 年 2 季度末，模型总体依旧呈现均衡偏价值的风格。未

来，本基金还是会基于量化模型得到最终持仓，Alpha 模型和风险管理模型也会结合具体情况持续优化升级。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末融通中证 A500 指数增强 A 基金份额净值为 1.0149 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.49%，同期业绩比较基准收益率为-2.33%；

截至本报告期末融通中证 A500 指数增强 C 基金份额净值为 1.0142 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.42%，同期业绩比较基准收益率为-2.33%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾 2025 年上半年，我国经济总体较为平稳，GDP 增速上半年取得 5.3% 的好成绩，以旧换新政策带动消费持续结构性改善，服务消费也出现快速增长态势，高端制造业维持高增长势头，出口展现韧性，出口结构持续优化，但总体消费依旧偏弱，地产持续成为拖累项的问题依旧存在。4 月初突发的关税事件可能是 2025 年上半年的一个标志性事件，在此之前，市场经过一波拉升后量能逐渐衰减，市场情绪开始走弱，随着关税事件突发，市场经过一天大跌后持续走强，虽然在 6 月下旬似乎遇到了一定的上涨阻力，但最终逐渐突破市场预期的多个阻力位，持续超市场预期，量能也因此得到了明显提升，两融余额持续走高，市场情绪持续改善，短期形成一定的趋势行情。总体而言，此轮上涨主要还是由于流动性宽松带动市场风险偏好明显回暖，增量资金持续增配权益市场驱动，红利低波、微盘股、创新药、新消费和光模块等主题均存在结构性行情，2025 年上半年总体也表现较强。

展望 2025 年下半年，适度宽松的货币政策和积极有为的财政政策有望持续发力，经济有望底部持续改善，我国经济有望逐渐走向“强现实”。在经过 2025 年上半年的上涨后，A 股总体估值水平长期看依旧处在合理偏低估水平，在市场总体风险偏好提升后，未来 A 股市场有望获益于经济层面的持续改善，配置价值依旧较高。

从风格配置来看，第一，2025 年上半年小盘占优，展望 2025 年下半年，随着经济基本面逐渐改善，市场主要的驱动逻辑可能由流动性驱动转向基本面驱动，在加上小盘风格持续演绎后当下拥挤度已经有明显提高，后续存在调整风险，2025 年下半年或将有小盘占优逐渐转向与经济相关度更高的大中盘占优；第二，2025 年一季度价值占优，二季度成长占优，总体价值成长表现较为均衡，展望 2025 年下半年，随着市场风险偏好提升，成长有望逐渐占优。总体而言，大小盘风格维度，大盘或将逐渐占优；成长价值风格维度，成长或将逐渐占优。

本基金跟踪的中证 A500 指数聚焦大盘核心龙头板块，成长价值较为均衡。中短期而言，从风格演绎角度看，2025 年下半年依旧具备较高的配置价值；长期而言，随着政策持续发力，经济逐

渐改善，中证 A500 板块与经济基本面相关度较高，长期配置价值高，或将持续受益于长线价值型资金的配置需求。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格按照《融通基金管理有限公司基金估值业务原则和程序管理细则》进行，公司设立由研究相关部门、风险管理部、登记清算部、稽核审计部和法律合规部共同组成的估值委员会，通过参考行业协会估值意见、参考独立第三方估值服务机构的估值数据等一种或多种方式的有效结合，减少或避免估值偏差的发生。

估值委员会定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况下及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值政策和程序的修订须经公司总经理办公会议审批后方可实施。基金在采用新投资策略或投资新品种时，应评价现有估值政策和程序的适用性。

截至本报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签订服务协议，由其提供相关债券品种和流通受限股票的估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合法律法规和基金合同的规定。

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数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

§ 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，基金托管人在融通中证 A500 指数增强型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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，融通基金管理有限公司在融通中证 A500 指数增强型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，由融通基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关融通中证 A500 指数增强型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、

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：融通中证 A500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日
资产：		
货币资金	6. 4. 7. 1	27,775,642.15
结算备付金		—
存出保证金		—
交易性金融资产	6. 4. 7. 2	95,736,129.36
其中：股票投资		95,736,129.36
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	6. 4. 7. 5	—
其中：债券投资		—
资产支持证券投资		—
其他投资		—
其他债权投资	6. 4. 7. 6	—
其他权益工具投资	6. 4. 7. 7	—
应收清算款		—
应收股利		—
应收申购款		135,804.34
递延所得税资产		—
其他资产	6. 4. 7. 8	—
资产总计		123,647,575.85
负债和净资产	附注号	本期末 2025 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		10,452,348.85
应付管理人报酬		97,076.76
应付托管费		12,134.59
应付销售服务费		18,150.09
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	6.4.7.9	53,444.56
负债合计		10,633,154.85
净资产：		
实收基金	6.4.7.10	111,408,245.18
其他综合收益	6.4.7.11	—
未分配利润	6.4.7.12	1,606,175.82
净资产合计		113,014,421.00
负债和净资产总计		123,647,575.85

注：1、报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额总额 111,408,245.18 份，其中融通中证 A500 指数增强 A 类基金份额 31,916,660.93 份，基金份额净值 1.0149 元；融通中证 A500 指数增强 C 类基金份额 79,491,575.25 份，基金份额净值 1.0142 元。

2、本基金合同生效日为 2025 年 3 月 18 日，2025 年中期报告实际报告期间为 2025 年 3 月 18 日至 2025 年 6 月 30 日。截止报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.2 利润表

会计主体：融通中证 A500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 3 月 18 日（基金合同 生效日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业收入		3,600,517.59
1. 利息收入		846,261.79
其中：存款利息收入	6.4.7.13	471,345.36
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		374,916.43
其他利息收入		—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,641,279.80
其中：股票投资收益	6.4.7.14	528,340.84
基金投资收益		—

债券投资收益	6. 4. 7. 15	160, 675. 82
资产支持证券投资收益	6. 4. 7. 16	—
贵金属投资收益	6. 4. 7. 17	—
衍生工具收益	6. 4. 7. 18	—
股利收益	6. 4. 7. 19	952, 263. 14
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. 20	1, 111, 770. 16
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. 21	1, 205. 84
减：二、营业总支出		997, 612. 29
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	712, 189. 86
其中：暂估管理人报酬		—
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	89, 023. 68
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	142, 954. 19
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. 22	—
7. 税金及附加		—
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	53, 444. 56
三、利润总额（亏损总额以“-”号 填列）		2, 602, 905. 30
减：所得税费用		—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2, 602, 905. 30
五、其他综合收益的税后净额		—
六、综合收益总额		2, 602, 905. 30

6.3 净资产变动表

会计主体：融通中证 A500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期				
	2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）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	—	—	—	—	—
加：会计政策变更	—	—	—	—	—
前期差错更正	—	—	—	—	—
其他	—	—	—	—	—
二、本期期初净资产	662, 501, 343. 71	—	—	—	662, 501, 343. 71

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-551,093,098.53	-	1,606,175.82	-549,486,922.71
（一）、综合收益总额	-	-	2,602,905.30	2,602,905.30
（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)	-551,093,098.53	-	-996,729.48	-552,089,828.01
其中：1. 基金申购款	17,306,688.71	-	2,873.13	17,309,561.84
2. 基金赎回款	-568,399,787.24	-	-999,602.61	-569,399,389.85
（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	111,408,245.18	-	1,606,175.82	113,014,421.00

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：

商小虎

王智鲲

刘美丽

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

融通中证 A500 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2024]1680 号文《关于准予融通中证 A500 指数增强型证券投资基金注册的批复》准予注册，由融通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《融通中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 662,382,688.82 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 70072774_H04 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《融通中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2025 年 3 月 18 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 662,501,343.71 份基金份额，其中认购资金利息折合 118,654.89 份基金份额。本基金的基金管理人为融通基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《融通中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》及《融通中证 A500 指数增强型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式等不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购费/申购费，但不从本类别基金资产中

计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；不收取认购费和申购费，而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板及其他依法发行上市的股票、存托凭证）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、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（含分离交易可转债）、可交换债券及其他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）、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金的投资组合比例为：本基金投资于股票（含存托凭证）的资产比例不低于基金资产的 80%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%，投资于港股通标的股票的比例占本基金股票资产的 0%-50%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证 A500 指数收益率 \times 95% + 人民币活期存款利率（税后） \times 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）起至 2025 年 6 月 30 日止期间的经营成果和

净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系自 2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）起至 2025 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据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分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产。

（2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为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，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期

信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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）不存在活跃市场的金融工具，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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，才使用不可观察输入值；

（3）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，

同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。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。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占基金净资产比例计算的金额。

未实现损益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利得/（损失）占基金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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

(1) 对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

(2) 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，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债务工具投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外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的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税后的净额计入公允价值变动损益。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的相关税费后的净额确认为投资收益。

本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1) 本基金收取股利的权利已经确立；2) 与股利相关的经济利益很可能流入本基金；3) 股利的金额能够可靠计量。

(3) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

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，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。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 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

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) 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) 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

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

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

(1) 增值税及附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债券利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按7%、3%和2%的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

(2) 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，

自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，（如有）证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，（如有）证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

（4）印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰ 调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、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》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（5）境外投资

本基金运作过程中如有涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	15,214,656.28
等于： 本金	15,208,050.35
加： 应计利息	6,605.93
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	12,560,985.87
等于： 本金	12,560,507.52
加： 应计利息	478.35
减： 坏账准备	—
合计	27,775,642.15

注：其他存款本期末金额为存放在证券经纪商专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	94,624,359.20	—	95,736,129.36	1,111,770.16
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	94,624,359.20	—	95,736,129.36	1,111,770.16

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

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

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**

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资**6.4.7.5.1 债权投资情况**

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资**6.4.7.6.1 其他债权投资情况**

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资**6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
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	53,444.56
合计	53,444.56

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

融通中证 A500 指数增强 A

项目	本期	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	113,139,668.39	113,139,668.39
本期申购	820,605.36	820,605.36
本期赎回（以“-”号填列）	-82,043,603.82	-82,043,603.82
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	31,916,669.93	31,916,669.93

融通中证 A500 指数增强 C

项目	本期	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	549,361,675.32	549,361,675.32
本期申购	16,486,083.35	16,486,083.35
本期赎回（以“-”号填列）	-486,356,183.42	-486,356,183.42
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	79,491,575.25	79,491,575.25

注：申购含红利再投及转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

融通中证 A500 指数增强 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	—	—	—
加：会计政策变更	—	—	—
前期差错更正	—	—	—
其他	—	—	—
本期期初	—	—	—
本期利润	371,557.51	249,784.68	621,342.19
本期基金份额交易产生的变动数	-95,407.22	-50,927.43	-146,334.65
其中：基金申购款	2,116.06	-2,692.10	-576.04
基金赎回款	-97,523.28	-48,235.33	-145,758.61
本期已分配利润	—	—	—
本期末	276,150.29	198,857.25	475,007.54

融通中证 A500 指数增强 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	—	—	—
加：会计政策变更	—	—	—
前期差错更正	—	—	—
其他	—	—	—
本期期初	—	—	—
本期利润	1,119,577.63	861,985.48	1,981,563.11
本期基金份额交易产生的变动数	-483,287.01	-367,107.82	-850,394.83
其中：基金申购款	32,741.33	-29,292.16	3,449.17
基金赎回款	-516,028.34	-337,815.66	-853,844.00
本期已分配利润	—	—	—
本期末	636,290.62	494,877.66	1,131,168.28

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	383,206.52
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	88,138.84
结算备付金利息收入	—
其他	—
合计	471,345.36

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

6.4.7.14 股票投资收益股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年3月18日（基金合同生效日）至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	528,340.84
股票投资收益——赎回差价收入	—
股票投资收益——申购差价收入	—
股票投资收益——证券出借差价收入	—
合计	528,340.84

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年3月18日（基金合同生效日）至 2025年6月30日
卖出股票成交总额	69,462,699.29
减：卖出股票成本总额	68,839,762.24
减：交易费用	94,596.21
买卖股票差价收入	528,340.84

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年3月18日（基金合同生效日） 至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	177,031.92
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入	-16,356.10
债券投资收益——赎回差价收入	—
债券投资收益——申购差价收入	—
合计	160,675.82

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年3月18日（基金合同生效日）至 2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	152,385,623.96
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	150,058,738.00
减：应计利息总额	2,340,195.96

减：交易费用	3,046.10
买卖债券差价收入	-16,356.10

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	952,263.14
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	952,263.14

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	1,111,770.16
股票投资	1,111,770.16
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	1,111,770.16

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,205.84
合计	1,205.84

注：1. 本基金对持续持有期少于 7 日的基金份额收取 1.5% 的赎回费，并将赎回费用全额计入基金资产；对持续持有期不少于 7 日的基金份额不收取赎回费用。

2. 基金的转换费用包括转换费和补差费，其中不低于转换费的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

审计费用	17,333.68
信息披露费	36,110.88
证券出借违约金	-
合计	53,444.56

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，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期与本基金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
融通基金管理有限公司（“融通基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、基金销售机构
诚通证券股份有限公司（“诚通证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

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

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

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 2025 年 3 月 18 日 (基金合同生效日) 至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	712,189.86
其中: 应支付销售机构的客户维护费	263,465.96
应支付基金管理人的净管理费	448,723.90

注: 基金管理费每日计提, 按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.80% 年费率计提。计算方法如下:

$$H = E \times 0.80\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期 2025 年 3 月 18 日 (基金合同生效日) 至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	89,023.68

注: 基金托管费每日计提, 按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 年费率计提。计算方法如下:

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

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 2025 年 3 月 18 日 (基金合同生效日) 至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	融通中证 A500 指数增强 A	融通中证 A500 指数增强 C	合计
融通基金	-	12.26	12.26
交通银行	-	32,846.21	32,846.21
诚通证券	-	2,139.31	2,139.31
合计	-	34,997.78	34,997.78

注: 销售服务费每日计提, 按月支付。本基金 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年费率为 0.20%。计算方法如下:

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日 C 类基金份额应支付的销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额的基金资产净值

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

无。

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**

无。

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

无。

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**

无。

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

无。

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	
	2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行	15,208,050.35	383,206.52

注：本基金由基金托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2025 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**

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

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

本基金为跟踪指数的股票型基金，主要投资于标的指数成份券及备选成份券，其预期风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金如果投资港股通标的股票，可能会面临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。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资等。本基金在日常经营活动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制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金在严格控制风险并保持基金资产流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。

本基金的基金管理人奉行内控优先和全员风险管理理念，高度重视风险管理的组织保障和制度保障，建立了完备的风险管理组织及相应的制度和流程，力争在风险最小化的前提下，确保基金份额持有人利益最大化。

本基金管理人在董事会下设立风险控制与审计委员会，履行相应风险管理及监督职责。

在公司管理层下设立风险管理委员会，负责指导、协调和监督各职能部门和个业务单元开展风险管理；识别公司各项业务所涉及的各类重大风险，对重大风险、重大决策和重要业务流程的风险进行评估，制定重大风险的解决方案；根据公司风险管理总体策略和各职能部门与业务单元职责分工，组织实施风险应对方案。

公司所有员工是本岗位风险管理的直接责任人，各业务部门负责人是其部门风险管理的第一责任人，基金经理是相应投资组合风险管理的第一责任人。

风险管理部对公司风险管理承担独立评估、监控、检查和报告职责，负责执行公司的风险管理战略和决策，拟定公司管理制度，并协同各业务部门制定风险管理流程、评估指标。

监察稽核相关部门负责监察公司各业务部门在相关法律法规、规章制度和业务流程执行方面

的情况，确保既定的风险管理措施得到有效的贯彻执行。

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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人或具备第三方存管资格的银行保管，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 2025 年 6 月 30 日，本基金无债券投资。

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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中列示的部分基金资产流通暂时受限制外，其余均能及时变现。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。除本报告“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”章节中列示的卖出回购金融资产款余额将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

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银行存款、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 2025 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	27,775,642.15	-	-	-	27,775,642.15
交易性金融资产	-	-	-	95,736,129.36	95,736,129.36
应收申购款	-	-	-	135,804.34	135,804.34
资产总计	27,775,642.15	-	-	95,871,933.70	123,647,575.85
负债					
应付赎回款	-	-	-	10,452,348.85	10,452,348.85
应付管理人报酬	-	-	-	97,076.76	97,076.76
应付托管费	-	-	-	12,134.59	12,134.59
应付销售服务费	-	-	-	18,150.09	18,150.09
其他负债	-	-	-	53,444.56	53,444.56
负债总计	-	-	-	10,633,154.85	10,633,154.85
利率敏感度缺口	27,775,642.15	-	-	85,238,778.85	113,014,421.00

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 2025 年 6 月 30 日，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净资产无重大影响。

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。本基金持有的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

无。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临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。

本基金运用指数化投资方式，通过研究标的指数成份股的构成及其权重确定本基金投资组合的基本构成和大致占比，并通过控制投资组合中成份股对标的指数中权重的偏离，以控制跟踪误差，进而达成对标的指数的跟踪目标。风险管理部负责对基金组合的跟踪误差和风险进行评估，定期提交组合跟踪误差和风险监控报告。在跟踪误差超过一定范围时，通知基金经理和相关部门，及时进行投资组合的调整。投资决策委员会根据市场变化对投资组合计划提出风险防范措施。监察稽核部对投资的决策和执行过程进行日常监督。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票（含存托凭证）的资产比例不低于基金资产的 80%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%，投资于港股通标的股票的比例占本基金股票资产的 0%-50%。本基金每个交易日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。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 2025 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	95,736,129.36	84.71
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	95,736,129.36	84.71

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 A500 指数收益率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 (2025 年 6 月 30 日)
1. 中证 A500 指数收益率上升 5%		381,303.56
2. 中证 A500 指数收益率下降 5%		-381,303.56

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 2025 年 6 月 30 日
第一层次	95,736,129.36
第二层次	—
第三层次	—
合计	95,736,129.36

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资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，确定相关投资的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

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	95,736,129.36	77.43
	其中：股票	95,736,129.36	77.43
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	27,775,642.15	22.46
8	其他各项资产	135,804.34	0.11
9	合计	123,647,575.85	100.00

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	483,115.00	0.43
B	采矿业	5,288,008.00	4.68
C	制造业	41,714,672.78	36.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,151,860.00	2.79

E	建筑业	2,219,642.00	1.96
F	批发和零售业	1,733,516.00	1.53
G	交通运输、仓储和邮政业	2,043,715.00	1.81
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,875,772.00	3.43
J	金融业	13,933,295.00	12.33
K	房地产业	892,125.00	0.79
L	租赁和商务服务业	804,047.00	0.71
M	科学研究和技术服务业	1,140,620.00	1.01
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	997,861.00	0.88
S	综合	-	-
	合计	78,278,248.78	69.26

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	-	-
C	制造业	10,709,342.58	9.48
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	1,690,546.00	1.50
G	交通运输、仓储和邮政业	1,410,578.00	1.25
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	873,121.00	0.77
J	金融业	2,655,453.00	2.35
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	118,840.00	0.11
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	17,457,880.58	15.45

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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	2,800	3,946,656.00	3.49
2	300750	宁德时代	12,700	3,203,194.00	2.83
3	600036	招商银行	60,400	2,775,380.00	2.46
4	601318	中国平安	48,100	2,668,588.00	2.36
5	600667	太极实业	260,900	1,716,722.00	1.52
6	002594	比亚迪	4,900	1,626,359.00	1.44
7	600900	长江电力	51,600	1,555,224.00	1.38
8	601988	中国银行	274,900	1,544,938.00	1.37
9	000651	格力电器	31,800	1,428,456.00	1.26
10	000333	美的集团	17,900	1,292,380.00	1.14
11	600008	首创环保	421,600	1,273,232.00	1.13
12	000725	京东方 A	318,100	1,269,219.00	1.12
13	300207	欣旺达	62,400	1,251,744.00	1.11
14	688235	百济神州	4,974	1,162,125.36	1.03
15	688256	寒武纪	1,900	1,142,850.00	1.01
16	002202	金风科技	111,300	1,140,825.00	1.01
17	603259	药明康德	16,400	1,140,620.00	1.01
18	000858	五 粮 液	9,500	1,129,550.00	1.00
19	000001	平安银行	92,400	1,115,268.00	0.99
20	600745	闻泰科技	32,700	1,096,431.00	0.97
21	600887	伊利股份	38,400	1,070,592.00	0.95
22	601728	中国电信	136,100	1,054,775.00	0.93
23	600584	长电科技	31,100	1,047,759.00	0.93
24	603799	华友钴业	28,000	1,036,560.00	0.92
25	600352	浙江龙盛	101,600	1,032,256.00	0.91
26	601166	兴业银行	43,400	1,012,956.00	0.90
27	002625	光启技术	25,300	1,011,494.00	0.90
28	300182	捷成股份	181,100	997,861.00	0.88
29	600050	中国联通	185,700	991,638.00	0.88
30	601766	中国中车	139,900	984,896.00	0.87
31	600276	恒瑞医药	18,900	980,910.00	0.87
32	601919	中远海控	64,100	964,064.00	0.85
33	601398	工商银行	126,500	960,135.00	0.85
34	601899	紫金矿业	49,100	957,450.00	0.85
35	600104	上汽集团	59,300	951,765.00	0.84
36	601857	中国石油	109,700	937,935.00	0.83
37	601607	上海医药	51,800	926,184.00	0.82
38	600741	华域汽车	52,000	917,800.00	0.81
39	601727	上海电气	122,800	907,492.00	0.80

40	000538	云南白药	16,200	903,798.00	0.80
41	002244	滨江集团	91,500	892,125.00	0.79
42	600489	中金黄金	60,900	890,967.00	0.79
43	601168	西部矿业	51,600	858,108.00	0.76
44	600219	南山铝业	215,800	826,514.00	0.73
45	600919	江苏银行	63,000	752,220.00	0.67
46	600019	宝钢股份	114,100	751,919.00	0.67
47	688981	中芯国际	8,378	738,688.26	0.65
48	601319	中国人保	83,100	723,801.00	0.64
49	601225	陕西煤业	37,500	721,500.00	0.64
50	601288	农业银行	120,600	709,128.00	0.63
51	600038	中直股份	17,200	667,532.00	0.59
52	002352	顺丰控股	13,600	663,136.00	0.59
53	000425	徐工机械	83,600	649,572.00	0.57
54	000977	浪潮信息	12,200	620,736.00	0.55
55	688122	西部超导	11,907	617,735.16	0.55
56	300433	蓝思科技	26,600	593,180.00	0.52
57	000338	潍柴动力	38,200	587,516.00	0.52
58	600585	海螺水泥	27,100	581,837.00	0.51
59	300059	东方财富	24,500	566,685.00	0.50
60	002027	分众传媒	75,900	554,070.00	0.49
61	300033	同花顺	2,000	546,020.00	0.48
62	600030	中信证券	18,400	508,208.00	0.45
63	600039	四川路桥	50,800	502,920.00	0.45
64	601877	正泰电器	22,100	501,007.00	0.44
65	002714	牧原股份	11,500	483,115.00	0.43
66	688608	恒玄科技	1,300	452,374.00	0.40
67	600309	万华化学	8,000	434,080.00	0.38
68	603993	洛阳钼业	48,400	407,528.00	0.36
69	600704	物产中大	71,600	377,332.00	0.33
70	002475	立讯精密	10,000	346,900.00	0.31
71	600028	中国石化	59,600	336,144.00	0.30
72	601985	中国核电	34,700	323,404.00	0.29
73	601006	大秦铁路	44,900	296,340.00	0.26
74	000034	神州数码	7,300	274,772.00	0.24
75	600346	恒力石化	19,100	272,366.00	0.24
76	600941	中国移动	2,300	258,865.00	0.23
77	002050	三花智控	9,500	250,610.00	0.22
78	601888	中国中免	4,100	249,977.00	0.22
79	600096	云天化	11,300	248,261.00	0.22
80	300014	亿纬锂能	5,100	233,631.00	0.21
81	300476	胜宏科技	1,700	228,446.00	0.20
82	000960	锡业股份	14,700	224,910.00	0.20

83	002371	北方华创	500	221,105.00	0.20
84	600143	金发科技	21,300	219,603.00	0.19
85	600031	三一重工	12,000	215,400.00	0.19
86	601633	长城汽车	9,600	206,208.00	0.18
87	300760	迈瑞医疗	900	202,275.00	0.18
88	300017	网宿科技	16,700	179,024.00	0.16
89	601088	中国神华	4,400	178,376.00	0.16
90	002414	高德红外	16,700	171,175.00	0.15
91	601100	恒立液压	2,300	165,600.00	0.15
92	600563	法拉电子	1,500	163,635.00	0.14
93	600998	九州通	30,200	155,228.00	0.14
94	600989	宝丰能源	9,300	150,102.00	0.13
95	301236	软通动力	2,500	136,600.00	0.12
96	300308	中际旭创	900	131,274.00	0.12
97	688041	海光信息	900	127,161.00	0.11
98	601816	京沪高铁	20,900	120,175.00	0.11
99	002001	新和成	5,600	119,112.00	0.11
100	688111	金山办公	400	112,020.00	0.10
101	002841	视源股份	3,100	107,260.00	0.09
102	600177	雅戈尔	12,900	94,170.00	0.08
103	300274	阳光电源	1,200	81,324.00	0.07
104	603501	豪威集团	500	63,825.00	0.06
105	600482	中国动力	2,400	55,368.00	0.05
106	600000	浦发银行	3,600	49,968.00	0.04

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	600713	南京医药	334,100	1,690,546.00	1.50
2	600268	国电南自	197,600	1,545,232.00	1.37
3	600020	中原高速	295,100	1,410,578.00	1.25
4	601688	华泰证券	79,100	1,408,771.00	1.25
5	600496	精工钢构	424,500	1,358,400.00	1.20
6	002396	星网锐捷	59,500	1,335,775.00	1.18
7	000823	超声电子	88,500	1,048,725.00	0.93
8	300803	指南针	12,800	1,032,448.00	0.91
9	603698	航天工程	40,400	711,848.00	0.63
10	000902	新洋丰	45,500	629,265.00	0.56
11	002376	新北洋	79,500	617,715.00	0.55
12	600169	太原重工	237,400	574,508.00	0.51
13	002649	博彦科技	32,000	464,960.00	0.41
14	601678	滨化股份	109,200	452,088.00	0.40
15	300232	洲明科技	59,900	433,676.00	0.38
16	002303	美盈森	104,000	370,240.00	0.33

17	600742	富维股份	31,900	303,369.00	0.27
18	000895	双汇发展	11,100	270,951.00	0.24
19	688522	纳睿雷达	5,091	260,761.02	0.23
20	300770	新媒股份	5,900	235,941.00	0.21
21	600728	佳都科技	31,600	172,220.00	0.15
22	600273	嘉化能源	19,200	162,432.00	0.14
23	600866	星湖科技	21,100	145,801.00	0.13
24	000589	贵州轮胎	29,900	136,643.00	0.12
25	601998	中信银行	15,600	132,600.00	0.12
26	300662	科锐国际	4,000	118,840.00	0.11
27	688388	嘉元科技	5,582	112,086.56	0.10
28	600060	海信视像	4,200	96,684.00	0.09
29	300999	金龙鱼	3,100	91,543.00	0.08
30	000987	越秀资本	11,900	81,634.00	0.07
31	603529	爱玛科技	1,500	51,600.00	0.05

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	4,974,930.00	4.40
2	300750	宁德时代	3,671,618.00	3.25
3	601318	中国平安	3,104,037.00	2.75
4	600036	招商银行	3,041,963.00	2.69
5	002202	金风科技	2,665,079.00	2.36
6	600008	首创环保	2,004,662.00	1.77
7	600713	南京医药	1,873,614.00	1.66
8	600900	长江电力	1,858,686.00	1.64
9	002594	比亚迪	1,812,774.00	1.60
10	600667	太极实业	1,802,069.00	1.59
11	000333	美的集团	1,772,369.00	1.57
12	000823	超声电子	1,760,709.13	1.56
13	000725	京东方 A	1,672,984.00	1.48
14	600020	中原高速	1,643,398.00	1.45
15	601988	中国银行	1,643,351.00	1.45
16	600352	浙江龙盛	1,640,055.00	1.45
17	600268	国电南自	1,587,207.00	1.40
18	000651	格力电器	1,568,233.00	1.39
19	688235	百济神州	1,550,565.20	1.37
20	601168	西部矿业	1,523,092.00	1.35

注：“买入金额”是指买入股票成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

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	002202	金风科技	1,554,800.00	1.38
2	600482	中国动力	1,423,391.00	1.26
3	600048	保利发展	1,193,738.00	1.06
4	603916	苏博特	1,003,516.00	0.89
5	600098	广州发展	963,588.00	0.85
6	002081	金螳螂	929,658.00	0.82
7	601668	中国建筑	913,112.00	0.81
8	000050	深天马 A	887,692.00	0.79
9	600332	白云山	856,388.00	0.76
10	601555	东吴证券	827,143.00	0.73
11	000823	超声电子	822,722.00	0.73
12	300604	长川科技	795,286.00	0.70
13	002479	富春环保	776,200.00	0.69
14	600089	特变电工	772,038.00	0.68
15	002376	新北洋	766,728.00	0.68
16	300699	光威复材	757,950.00	0.67
17	000623	吉林敖东	757,552.00	0.67
18	601168	西部矿业	753,439.00	0.67
19	300657	弘信电子	735,698.00	0.65
20	601677	明泰铝业	725,356.00	0.64

注：“卖出金额”是指卖出股票成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

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	163,464,121.44
卖出股票收入（成交）总额	69,462,699.29

注：表中“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（成交）总额”均指成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

7.10 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，以套期保值为目的，有选择地参与股指期货交易。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货交易时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

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**

本基金参与国债期货交易是为了有效控制债券市场的系统性风险，本基金将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，适度运用国债期货提高投资组合运作效率。在参与国债期货交易时，基金管理人通过对宏观经济和利率市场走势的分析与判断，并充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置，谨慎进行投资，以调整债券组合的久期，降低投资组合的整体风险。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

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**

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

7.12.2 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

无。

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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	135,804.34
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	135,804.34

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

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

无。

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

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
融通中证 A500 指数增强 A	295	108,192.10	49,603.17	0.16	31,867,066.76	99.84
融通中证 A500 指数增强 C	931	85,383.00	10,059,165.66	12.65	69,432,409.59	87.35
合计	1,226	90,871.33	10,108,768.83	9.07	101,299,476.35	90.93

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	融通中证 A500 指数增强 A	-	-
	融通中证 A500 指数增强 C	-	-
	合计	-	-

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	融通中证 A500 指数增强 A	0
	融通中证 A500 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	融通中证 A500 指数增强 A	0
	融通中证 A500 指数增强 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	融通中证 A500 指数增强 A	融通中证 A500 指数增强 C
基金合同生效日(2025 年 3 月 18 日) 基金份额总额	113,139,668.39	549,361,675.32
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	820,605.36	16,486,083.35
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	82,043,603.82	486,356,183.42
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	31,916,669.93	79,491,575.25

§ 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

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，本基金的基金管理人无重大人事变动。

10.2.2 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、基金财产及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，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的托管人托管业务部门及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用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(%)	
西南证券	3	139,217,110.36	59.77	29,810.55	62.14	-
东海证券	3	52,023,883.08	22.33	9,995.83	20.84	-
华创证券	3	41,685,827.29	17.90	8,167.62	17.03	-

注：1 本基金使用券商交易模式。

2、本基金选择的券商是西南证券、东海证券、华创证券。本基金管理人与西南证券、东海证券、华创证券不存在关联方关系。

3. 券商交易模式下的券商选择标准为：

(1) 券商财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易等服务能力较强，同时拥有良好的公司声誉。

(2) 券商研究实力较强，有稳定的研究机构和专业的研究人员，能及时为本公司提供高质量的研究支持与服务，包括宏观与策略报告、行业与公司分析报告、债券市场分析报告和金融衍生品分析报告等，并能根据基金投资的特定需求，提供专门研究报告。

(3) 严禁将券商选择、交易量分配等与基金销售规模、保有规模挂钩，严禁以任何形式向券商承诺基金证券交易量及佣金或利用交易佣金与券商进行利益交换。

(4) 公司销售业务人员不得参与券商选择、协议签订、服务评价、交易佣金分配等业务环节。

(5) 公司不得使用交易佣金向第三方转移支付费用，包括但不限于使用外部专家咨询、金融终端、研报平台、数据库等产生的费用。

4. 券商交易模式下的券商选择程序为：

(1) 本基金管理人根据上述标准对券商进行考察评价后，经公司内部审批程序确定选用的券商；

(2) 本基金管理人和被选中的券商签订经纪服务协议。

5. 交易单元变更情况

本基金使用券商交易模式，本基金选择的券商是西南证券、东海证券、华创证券，本报告期内无变更。

10.7.2 基金租用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	
	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(%)
西南证券	300,104,166.00	100.00	1,060,099,000.00	100.00	—	—
东海证券	—	—	—	—	—	—
华创证券	—	—	—	—	—	—

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	融通中证 A500 指数增强型证券投资基金新增销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 2 月 17 日
2	融通中证 A500 指数增强型证券投资基金新增销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 2 月 19 日
3	融通中证 A500 指数增强型证券投资基金新增销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 2 月 20 日
4	融通基金管理有限公司关于提醒投资者注意防范不法分子诈骗活动的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 2 月 28 日
5	融通中证 A500 指数增强型证券投资基金新增销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 3 月 3 日
6	融通基金管理有限公司关于暂停部分销售机构办理相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 3 月 14 日
7	关于融通中证 A500 指数增强型证券投资基金提前结束募集的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 3 月 14 日
8	融通中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 3 月 19 日
9	融通基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 3 月 31 日
10	融通基金关于旗下部分开放式基金新增中国银河证券股份有限公司为销售机构及开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 3 月 31 日
11	融通中证 A500 指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资及转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 4 月 15 日
12	融通基金管理有限公司关于系统升级期间暂停服务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 4 月 16 日

13	融通基金管理有限公司关于提醒投资者警惕虚假网站和 APP 的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 5 月 26 日
14	融通基金管理有限公司关于旗下部分基金在部分销售机构开通转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 5 月 30 日
15	融通中证 A500 指数增强型证券投资基金新增招商银行股份有限公司为销售机构开通定期定额投资业务、转换业务及参加其开展的前端申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 6 月 5 日
16	融通基金管理有限公司关于终止民商基金销售（上海）有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 6 月 5 日

§ 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

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予融通中证 A500 指数增强型证券投资基金注册的文件
- (二) 《融通中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》
- (三) 《融通中证 A500 指数增强型证券投资基金托管协议》
- (四) 《融通中证 A500 指数增强型证券投资基金招募说明书》
- (五) 融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照
- (六) 报告期内在指定报刊上披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件，或登录本基金管理人网站 <http://www.rtfund.com> 查阅。

融通基金管理有限公司

2025 年 8 月 28 日