

泓德中证 A500 指数增强型证券投资基金

2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人:泓德基金管理有限公司

基金托管人:广发证券股份有限公司

送出日期:2026 年 03 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。本年度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。

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2026年3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。

本年度报告财务资料经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2025年3月11日（基金合同生效日）起至2025年12月31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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	22
7.4 报表附注	23
§8 投资组合报告	52
8.1 期末基金资产组合情况	52
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	53
8.3 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	55
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	80
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	83
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	83
8.7 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	84
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	84
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	84
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	84

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	84
8.12 投资组合报告附注	84
§9 基金份额持有人信息	86
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	86
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	86
9.3 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	86
§10 开放式基金份额变动	87
§11 重大事件揭示	87
11.1 基金份额持有人大会决议	87
11.2 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	88
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	88
11.4 基金投资策略的改变	88
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	88
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	88
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	89
11.8 其他重大事件	90
§12 影响投资者决策的其他重要信息	92
12.1 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	92
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	92
§13 备查文件目录	92
13.1 备查文件目录	92
13.2 存放地点	92
13.3 查阅方式	92

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泓德中证A500指数增强型证券投资基金	
基金简称	泓德中证A500指数增强	
基金主代码	023335	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025年03月11日	
基金管理人	泓德基金管理有限公司	
基金托管人	广发证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	141,503,097.37份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	泓德中证A500指数增强A	泓德中证A500指数增强C
下属分级基金的交易代码	023335	023336
报告期末下属分级基金的份额总额	52,856,626.21份	88,646,471.16份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制，力争实现长期超越标的指数的业绩表现。
投资策略	本基金以中证A500指数为标的指数，主要采用指数增强量化投资策略，力争控制本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8.0%，并力争在控制跟踪误差的基础上获得超越标的指数的超额收益。主要投资策略包括：股票投资策略、债券投资策略、金融衍生品投资策略及融资、转融通证券出借业务投资策略等。
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	本基金是一只股票指数增强型基金，其预期风险与预期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		泓德基金管理有限公司	广发证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李娇	罗琦
	联系电话	010-59850151	020-66338888
	电子邮箱	lijiao@hongdefund.com	gzluoqi@gf.com.cn
客户服务电话		4009-100-888	95575
传真		010-59850195	020-87553363-6847
注册地址		西藏自治区拉萨市柳梧新区 北京大道柳梧城投大厦A-120 6-1	广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室
办公地址		北京市西城区德胜门外大街1 25号	广州市天河区马场路26号广 发证券大厦34楼
邮政编码		100088	510627
法定代表人		王德晓	林传辉

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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.hongdefund.com
基金年度报告备置地点	北京市西城区德胜门外大街125号

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
注册登记机构	泓德基金管理有限公司	北京市西城区德胜门外大街125号

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	本期2025年03月11日（基金合同生效日） - 2025年12月31日	
	泓德中证A500指数 增强A	泓德中证A500指数 增强C
本期已实现收益	14,750,186.47	21,572,060.99
本期利润	18,861,445.30	26,519,445.10
加权平均基金份额本期利润	0.2100	0.2225
本期加权平均净值利润率	19.62%	20.45%
本期基金份额净值增长率	26.76%	26.35%
3.1.2 期末数据和指标	2025年末	
期末可供分配利润	12,318,569.26	20,300,437.16
期末可供分配基金份额利润	0.2331	0.2290
期末基金资产净值	67,002,876.87	112,008,470.88
期末基金份额净值	1.2676	1.2635
3.1.3 累计期末指标	2025年末	
基金份额累计净值增长率	26.76%	26.35%

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、期末可供分配利润，采用期末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（为期末余额，不是当期发生数）。

4、本基金基金合同生效日为2025年3月11日，本期财务报表的实际编制期间为2025年3月11日至2025年12月31日。

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

泓德中证A500指数增强A

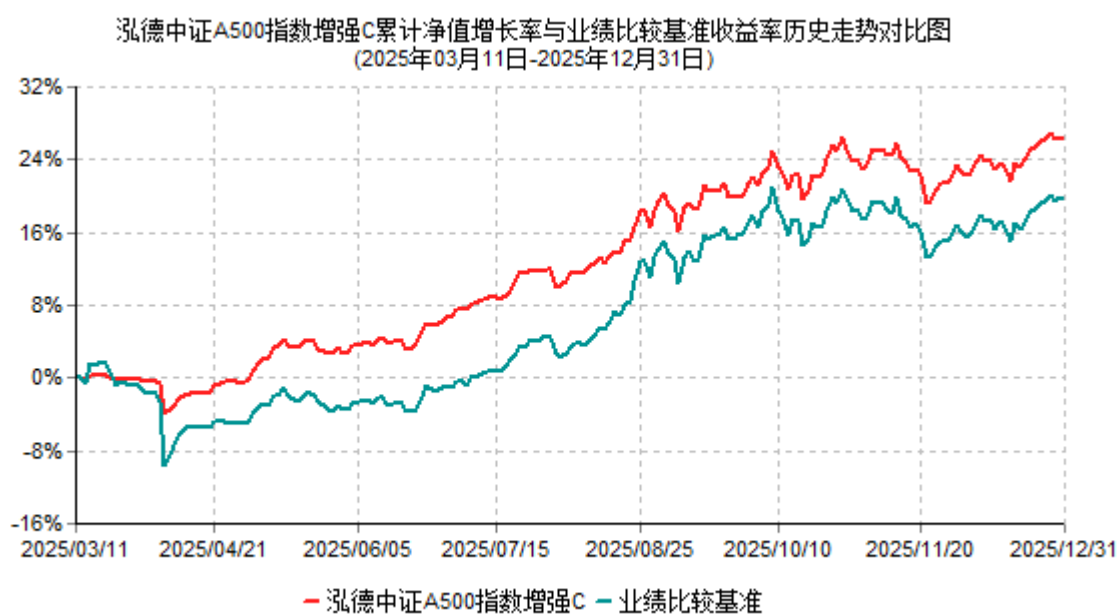
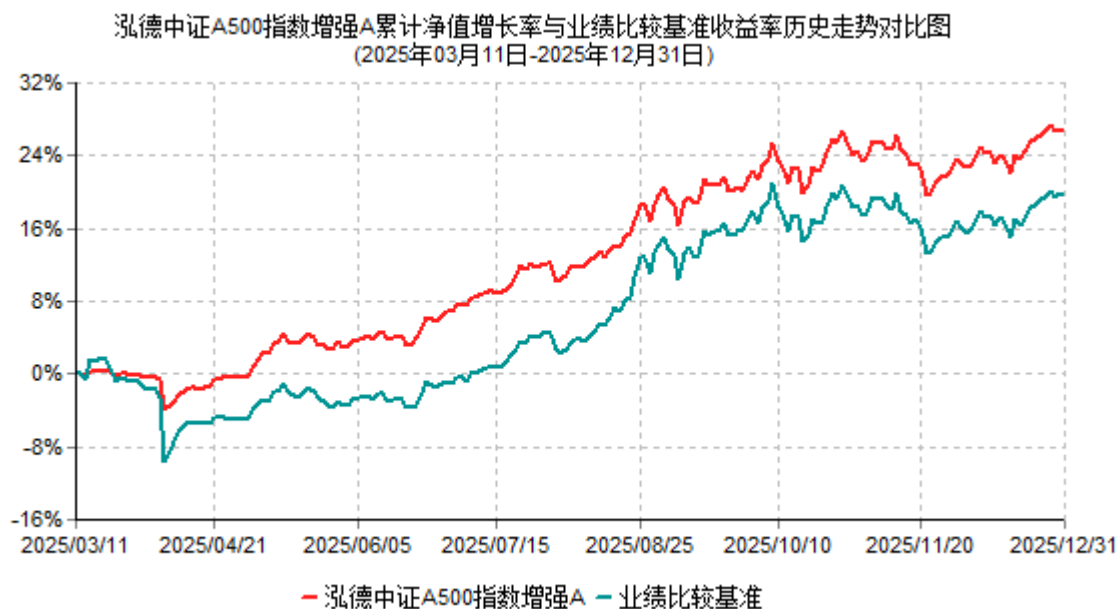
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	2.61%	0.91%	0.43%	1.00%	2.18%	-0.09%
过去六个月	19.11%	0.84%	20.71%	0.95%	-1.60%	-0.11%
自基金合同 生效起至今	26.76%	0.76%	19.59%	1.00%	7.17%	-0.24%

泓德中证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
过去三个月	2.52%	0.91%	0.43%	1.00%	2.09%	-0.09%
过去六个月	18.88%	0.84%	20.71%	0.95%	-1.83%	-0.11%
自基金合同 生效起至今	26.35%	0.76%	19.59%	1.00%	6.76%	-0.24%

注：本基金的业绩比较基准为：中证A500指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%

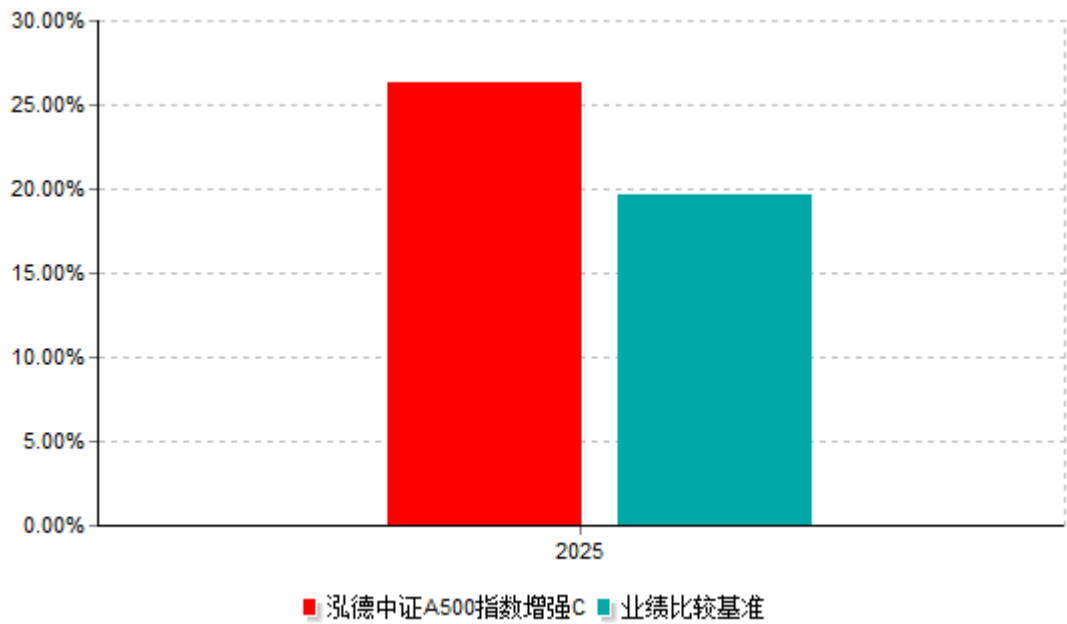
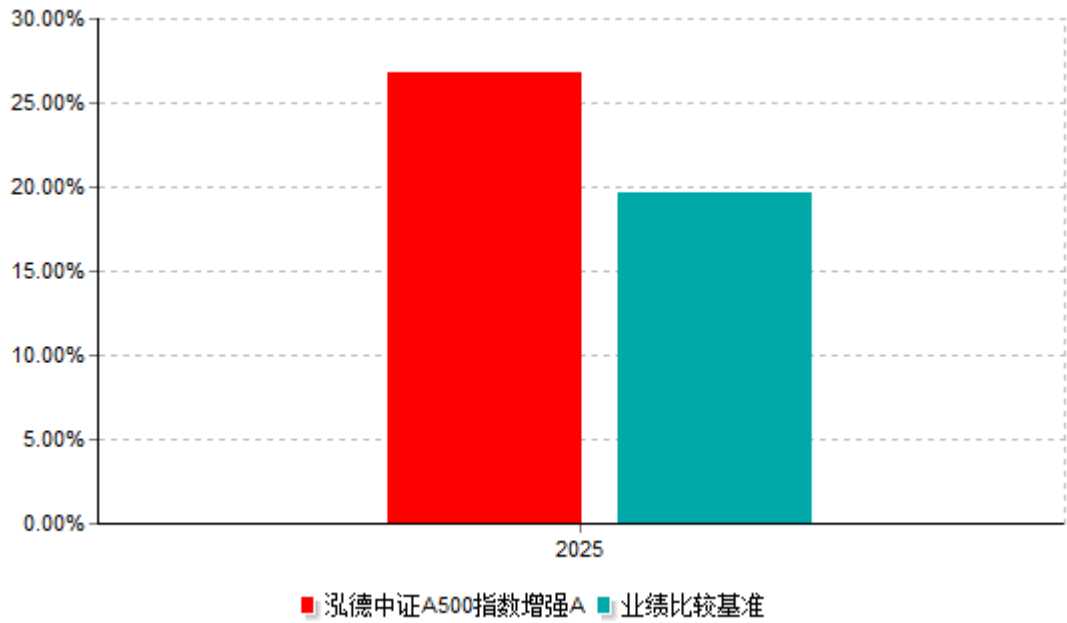
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、本基金的基金合同于2025年3月11日生效，截至2025年12月31日止，本基金成立未满1年。

2、根据基金合同的约定，本基金建仓期为6个月，截至报告期末，本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围及投资限制规定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同自2025年3月11日生效，生效当年净值增长率及业绩比较基准收益率按实际存续期计算，未按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

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

本基金管理人为泓德基金管理有限公司（以下简称“公司”或“泓德基金”），成立于2015年3月3日，是经中国证监会证监许可[2015]258号文批准设立的公募基金管理公司。公司注册资本为人民币1.43亿元，公司注册地拉萨市。

泓德基金始终以“为客户创造价值”为己任，坚持长期价值投资理念，发挥主动投资管理优势，致力于为广大投资者提供专业、优质、高效的资产管理服务，力争成为受人尊重的资产管理机构。

公司已建立科学规范的公司治理结构，全面有效的风险管理体系，稳定专业的投资研究团队，专业高效的市场服务体系，稳健的运营保障体系。公司已覆盖从公募到专户，从主动权益投资、量化投资到固定收益投资，从低风险到中、高风险等不同类型的公募基金产品涵盖股票型、债券型、混合型、货币型等主流基金品种，产品谱系不断完善，满足居民日益多元的财富管理需求。

未来公司将继续秉持投资者利益至上的初心，不断精进，推动公司高质量发展。

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		
李子昂	本基金的基金经理、智能投资部副总监	2025-03-11	-	12年	硕士研究生，具有基金从业资格，曾任本公司多资产投资部投资经理，北京隆慧投资有限公司投资管理部投资经理，华商基金管理有限公司量化投资部量化研究员，泰达宏利基金管理有限公司风险管理与基金评估部助理专员。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期，对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从中国证监会《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。

4.2 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、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，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。

本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《泓德基金管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《泓德基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

本报告期内，本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（1日内、3日内、5日内）的同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未出现超过该证券当日成交量的5%的情况。本报告期，未发现本基金存在异常交易行为。

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

报告期内，A股整体表现出不错的上涨态势，成长风格占据主导，机器人、创新药、CPO、半导体等科技热点层出不穷且表现出较好的延续性，中小市值股票总体表现更强。市场风险偏好提高，成交量明显抬升，虽有美国“对等关税”事件的短期扰动，但投资者整体获得感较好。我们的投资组合经历了上半年相对稳健的超额积累后，在8、9月份大盘成长集中上涨行情中出现了一定超额回撤，我们对成长因子和成长策略做了相对深入的修正，也使模型在成长环境下有更好表现，当然，我们依然追求一个相对均衡的表现，以免超额收益过分依赖风格与行情。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末泓德中证A500指数增强A基金份额净值为1.2676元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为26.76%，同期业绩比较基准收益率为19.59%；截至报告期末泓德中证A500指数增强C基金份额净值为1.2635元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为26.35%，同期业绩比较基准收益率为19.59%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

去年年初，DeepSeek引燃了国产大模型的投资热情，新年伊始，智谱和Minimax在港股的大幅上涨也在一定程度上反映了投资者对国产大模型的认可，毫无疑问，AI已经成为当今最重要的投资主题，技术快速发展迭代，新的应用层出不穷，当AI可以自主编程、校验，一扇新的大门便打开了。虽然越来越多的人开始担心AI泡沫，但我们依然看到巨大的技术进步空间和产业发展空间，当然技术的飞轮在快速转动，一定会有公司被淘汰，也一定会有新的公司涌现，我们需要时刻跟踪产业的发展趋势，才有可能不被落下。宏观方面，2025年，经济增速完成5%的预定目标，整体呈现前高后低特征，出口依然强劲，投资成为拖累项，特别是房地产投资加速滑落，但经济“向新而行”趋势明显，新经济占比已超过旧经济，新质生产力蓬勃发展。新年过后，上海出台楼市新规，进一步调减住房限购政策，上调公积金贷款额度，在推动地产小阳春的同时，也提升了大家对于后续稳楼市政策的预期。2026年是“十五五”开局之年，我们依然面临着复杂的外部环境，地缘政治、贸易摩擦不会停止，我们需要有更强的定力，我们也期待更多的宏观政策落地，不断巩固经济稳中向好的态势。权益市场经历了去年的百花齐放后，依然表现出较好韧性，风险偏好显著抬升，我们也在持续挖掘可能的Alpha特征，努力为投资者创造更好收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人继续完善内部控制体系和内部控制制度，健全管理制度和业务规章，依据国家相关法律法规、内部控制制度、内部管理制度和业务规章、基金合同以及基金招募说明书对本基金的投资、销售、运营等业务中的内部控制完善程度和

执行情况进行持续的监察稽核，对监察稽核中发现的问题及时提示，督促改进并跟踪改进效果。

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

（1）根据法律法规的要求，推动各业务单元更新、完善内部制度及业务流程。识别业务活动中的关键风险点，确定关键控制活动，持续完善内部控制措施。

（2）对合同、协议等法律文件及实务运作中存在的法律风险进行识别及防范。

（3）通过事前合规审核、持续优化合规监控系统、加强合规培训等方面，对业务活动中存在的合规风险进行识别及评估，完成各类合规管理工作。

（4）按计划完成定期稽核工作，检查内容覆盖公司主要业务部门和业务环节，并对整改情况进行跟踪。

（5）认真贯彻落实反洗钱各项法律法规，切实履行金融机构的反洗钱法定义务，将反洗钱工作贯穿于公司各项业务流程。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照《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相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。

本基金管理人制定了证券投资基金估值政策与估值程序，设立基金估值委员会，估值委员会负责指导和监督整个估值流程。估值委员会成员均具有多年证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、基金估值运作、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。基金经理参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已分别与中债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司签署服务协议，由其分别按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种和在交易所市场交易或挂牌的部分债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同第十六部分中对基金利润分配原则的约定，2025年度未实施利润分配。

本基金截至2025年12月31日，期末可供分配利润为32,619,006.42元，其中：泓德中证A500指数增强A期末可供分配利润为12,318,569.26元（泓德中证A500指数增强A的未

分配利润已实现部分为12,318,569.26元，未分配利润未实现部分为1,827,681.40元），泓德中证A500指数增强C期末可供分配利润为20,300,437.16元（泓德中证A500指数增强C的未分配利润已实现部分为20,300,437.16元，未分配利润未实现部分为3,061,562.56元）。

4.9 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，本基金管理人无应说明的预警信息。

§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，本基金托管人在对泓德中证A500指数增强型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金托管业务管理办法》等相关法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定勤勉履行基金托管人职责，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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，泓德基金管理有限公司在本基金各重要方面的运作符合基金合同、托管协议的约定，本基金托管人未发现本基金在投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支及利润分配等方面存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本基金托管人依法对泓德基金管理有限公司编制和披露的泓德中证A500指数增强型证券投资基金2025年年度报告中的财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2026）审字第80014975_A06号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
--------	------

审计报告收件人	泓德中证A500指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了泓德中证A500指数增强型证券投资基金的财务报表，包括2025年12月31日的资产负债表，2025年3月11日（基金合同生效日）至2025年12月31日止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的泓德中证A500指数增强型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了泓德中证A500指数增强型证券投资基金2025年12月31日的财务状况以及2025年3月11日（基金合同生效日）至2025年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第1号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于泓德中证A500指数增强型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	泓德中证A500指数增强型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读

	其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理层负责评估泓德中证A500指数增强型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督泓德中证A500指数增强型证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： （1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于

	未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 （2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 （3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 （4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对泓德中证A500指数增强型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致泓德中证A500指数增强型证券投资基金不能持续经营。 （5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	王珊珊	刘林厂
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室	
审计报告日期	2026-03-24	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：泓德中证A500指数增强型证券投资基金

报告截止日：2025年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025年12月31日
资 产：		
货币资金	7.4.7.1	12,951,964.31
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	151,666,440.01
其中：股票投资		151,621,972.31
基金投资		-
债券投资		44,467.70
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		17,790,271.44
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.5	-
资产总计		182,408,675.76
负债和净资产	附注号	本期末 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	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		3,104,664.24

应付管理人报酬		101,612.59
应付托管费		19,052.36
应付销售服务费		31,050.82
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	7.4.7.6	140,948.00
负债合计		3,397,328.01
净资产：		
实收基金	7.4.7.7	141,503,097.37
未分配利润	7.4.7.8	37,508,250.38
净资产合计		179,011,347.75
负债和净资产总计		182,408,675.76

注：报告截止日2025年12月31日，基金份额总额141,503,097.37份，其中A类基金份额总额为52,856,626.21份，基金份额净值为1.2676元；C类基金份额总额为88,646,471.16份，基金份额净值为1.2635元。

7.2 利润表

会计主体：泓德中证A500指数增强型证券投资基金

本报告期：2025年03月11日（基金合同生效日）至2025年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025年03月11日（基金合同 生效日）至2025年12月31 日
一、营业总收入		47,678,296.31
1.利息收入		590,074.98
其中：存款利息收入	7.4.7.9	590,074.98
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）		37,991,344.64
其中：股票投资收益	7.4.7.10	33,915,723.52
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.11	56.80
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.12	-
股利收益	7.4.7.13	4,075,564.32
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	9,058,642.94
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	38,233.75
减：二、营业总支出		2,297,405.91
1.管理人报酬		1,459,029.55
2.托管费		273,568.13
3.销售服务费		418,808.23
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		-
7.税金及附加		-
8.其他费用	7.4.7.16	146,000.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		45,380,890.40
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		45,380,890.40
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		45,380,890.40

7.3 净资产变动表

会计主体：泓德中证A500指数增强型证券投资基金

本报告期：2025年03月11日（基金合同生效日）至2025年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2025年03月11日（基金合同生效日）至2025年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	476,910,499.70	-	476,910,499.70
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-335,407,402.33	37,508,250.38	-297,899,151.95
（一）、综合收益总额	-	45,380,890.40	45,380,890.40
（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）	-335,407,402.33	-7,872,640.02	-343,280,042.35
其中：1.基金申购款	217,450,799.70	34,855,092.61	252,305,892.31
2.基金赎回款	-552,858,202.03	-42,727,732.63	-595,585,934.66
（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、本期期末净资产	141,503,097.37	37,508,250.38	179,011,347.75

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

王德晓

王德晓

王玲

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

泓德中证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”）证监许可[2025]37号《关于准予泓德中证A500指数增强型证券投资基金注册的批复》准予注册，由泓德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《泓德中证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476,792,483.26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80014975_A03号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泓德中证A500指数增强型证券投资基金基金合同》于2025年3月11日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为476,910,499.70份，其中认购资金利息折合118,016.44份基金份额。本基金的基金管理人为泓德基金管理有限公司，基金托管人为广发证券股份有限公司。

根据《泓德中证A500指数增强型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购费、申购费、销售服务费等收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。收取认（申）购费，不收取销售服务费的，称为A类基金份额；收取销售服务费，不收取认（申）购费的，称为C类基金份额。本基金A类基金份额、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：计算日某类基金份额净值=计算日该类基金份额的基金资产净值/计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泓德中证A500指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标：本基金为股票指数增强型基金，通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制，力争实现长期超越标的指数的业绩表现。本基金的投资范围主要包括国内依法发行上市的股票（含主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、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、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券等）、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）。本基金可根据法律法规的规定参与融资、转融通证券出借业务。基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产（含存托凭证）占基金资产的比例不低于基金资产的80%，投资于标的指数成

份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券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、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%+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泓德基金管理有限公司于2026年3月24日批准报出。

7.4.2 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2号《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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2025年3月11日（基金合同生效日）至2025年12月31日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2025年12月31日的财务状况以及2025年3月11日（基金合同生效日）至2025年12月31日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2025年3月11日（基金合同生效日）至2025年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产

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

债务工具

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

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

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

(2) 金融负债

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

(3) 衍生金融工具

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率

(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 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，但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。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

7.4.6.1 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‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，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。

7.4.6.2 增值税

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，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，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；

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，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

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，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让2017年12月31日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价（2017年最后一个交易日处于停牌期

间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

根据财政部、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》，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，继续免征增值税直至债券到期。

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，分别按规定的比例缴纳。

7.4.6.3 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。

7.4.6.4 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，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，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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日
活期存款	9,188,922.60
等于：本金	9,185,531.64
加：应计利息	3,390.96
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	3,763,041.71
等于：本金	3,762,901.70
加：应计利息	140.01
减：坏账准备	-
合计	12,951,964.31

注：其他存款为存放在证券经纪机构的证券资金账户中的证券交易结算资金。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		142,578,287.97	-	151,621,972.31	9,043,684.34
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	29,500.00	9.10	44,467.70	14,958.60
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	29,500.00	9.10	44,467.70	14,958.60

资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	142,607,787.97	9.10	151,666,440.01	9,058,642.94

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 其他资产

无。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31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	140,000.00
其他应付	948.00
合计	140,948.00

7.4.7.7 实收基金

7.4.7.7.1 泓德中证A500指数增强A

金额单位：人民币元

项目 (泓德中证A500指数增强A)	本期 2025年03月11日（基金合同生效日）至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	223,494,536.04	223,494,536.04
本期申购	38,923,667.31	38,923,667.31
本期赎回（以“-”号填列）	-209,561,577.14	-209,561,577.14
本期末	52,856,626.21	52,856,626.21

7.4.7.7.2 泓德中证A500指数增强C

金额单位：人民币元

项目 (泓德中证A500指数增强C)	本期 2025年03月11日（基金合同生效日）至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	253,415,963.66	253,415,963.66
本期申购	178,527,132.39	178,527,132.39
本期赎回（以“-”号填列）	-343,296,624.89	-343,296,624.89
本期末	88,646,471.16	88,646,471.16

注: 1、申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2、本基金于2025年2月17日至2025年3月7日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币476,792,483.26元，折合为476,792,483.26份基金份额(其中A类基金份额223,429,433.51份，C类基金份额253,363,049.75份)。根据《泓德中证A500指数增强型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币118,016.44元。在本基金成立后，折算为118,016.44份基金份额(其中A类基金份额65,102.53份，C类基金份额52,913.91份)，划入基金份额持有人账户。

3、根据《泓德中证A500指数增强型证券投资基金基金合同》、《泓德中证A500指数增强型证券投资基金招募说明书》及《泓德基金管理有限公司关于泓德中证A500指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告》的相关规定，

本基金于2025年3月11日(基金合同生效日)至2025年4月8日止期间暂不向投资人开放基金交易，申购、赎回、转换及定期定额投资业务自2025年4月9日起开始办理。

7.4.7.8 未分配利润

7.4.7.8.1 泓德中证A500指数增强A

单位：人民币元

项目 (泓德中证A500指数增强A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	14,750,186.47	4,111,258.83	18,861,445.30
本期基金份额交易产生的变动数	-2,431,617.21	-2,283,577.43	-4,715,194.64
其中：基金申购款	5,861,671.25	1,044,369.39	6,906,040.64
基金赎回款	-8,293,288.46	-3,327,946.82	-11,621,235.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,318,569.26	1,827,681.40	14,146,250.66

7.4.7.8.2 泓德中证A500指数增强C

单位：人民币元

项目 (泓德中证A500指数增强C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	21,572,060.99	4,947,384.11	26,519,445.10
本期基金份额交易产生的变动数	-1,271,623.83	-1,885,821.55	-3,157,445.38
其中：基金申购款	22,908,536.72	5,040,515.25	27,949,051.97
基金赎回款	-24,180,160.55	-6,926,336.80	-31,106,497.35
本期已分配利润	-	-	-

本期末	20,300,437.16	3,061,562.56	23,361,999.72
-----	---------------	--------------	---------------

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年03月11日（基金合同生效日）至2025年12月31日
活期存款利息收入	580,616.73
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	9,170.65
结算备付金利息收入	-
其他	287.60
合计	590,074.98

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪机构的证券资金账户中的证券交易结算资金产生的利息收入。

7.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年03月11日（基金合同生效日）至2025年12月31日
卖出股票成交总额	940,040,125.11
减：卖出股票成本总额	905,157,542.27
减：交易费用	966,859.32
买卖股票差价收入	33,915,723.52

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年03月11日（基金合同生效日）至2025年12月31日
----	--

债券投资收益——利息收入	9.19
债券投资收益——买卖债券 （债转股及债券到期兑付） 差价收入	47.61
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	56.80

7.4.7.11.2 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03月11日（基金合同生效日）至2025年12月31日
卖出债券（债转股 及债券到期兑付） 成交总额	247.71
减：卖出债券（债 转股及债券到期兑 付）成本总额	200.00
减：应计利息总额	0.09
减：交易费用	0.01
买卖债券差价收入	47.61

7.4.7.12 衍生工具收益

无。

7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年03月11日（基金合同生效日）至2025年12月31 日
股票投资产生的股利收益	4,075,564.32

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	4,075,564.32

7.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年03月11日（基金合同生效日）至2025年12月31日
1.交易性金融资产	9,058,642.94
——股票投资	9,043,684.34
——债券投资	14,958.60
——资产支持证券投资	-
——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	9,058,642.94

7.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年03月11日（基金合同生效日）至2025年12月31日
基金赎回费收入	38,081.85
基金转换费收入	151.90
合计	38,233.75

注：1、本基金的赎回费率随着持有期限的增加而递减，将不低于赎回费总额的25%计入基金财产。

2、本基金的转换费由申购补差费和赎回费两部分构成，其中不低于赎回费25%的部分归入转出基金的基金资产。

7.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年03月11日（基金合同生效日）至2025年12月31日
审计费用	40,000.00
信息披露费	100,000.00
证券出借违约金	-
账户维护费	6,000.00
合计	146,000.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
泓德基金管理有限公司（以下简称“泓德基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
广发证券股份有限公司（以下简称“广发证券”）	基金托管人、基金销售机构
王德晓	基金管理人的自然人股东
阳光资产管理股份有限公司	基金管理人股东
珠海市基业长青投资中心（有限合伙）	基金管理人股东
泓德基业（西藏）企业管理有限公司	基金管理人股东
南京民生租赁股份有限公司	基金管理人股东
江苏岛村实业发展有限公司	基金管理人股东

珠海市崇德企业管理咨询中心（有限合伙）	基金管理人股东
上海捷朔信息技术有限公司	基金管理人股东
珠海市广业企业管理咨询中心（有限合伙）	基金管理人股东
温永鹏	基金管理人的自然人股东
李晓春	基金管理人的自然人股东
王克玉	基金管理人的自然人股东
秦毅	基金管理人的自然人股东
李娇	基金管理人的自然人股东
李操纲	基金管理人的自然人股东

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年03月11日（基金合同生效日）至2025年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,459,029.55
其中：应支付销售机构的客户维护费	689,117.21
应支付基金管理人的净管理费	769,912.34

注：支付基金管理人泓德基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.80%的年费率每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：
日管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.80%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年03月11日（基金合同生效日）至2025年12月
----	-------------------------------------

	31日
当期发生的基金应支付的托管费	273,568.13

注：支付基金托管人广发证券的托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：
日托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

7.4.10.2.3 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03月11日（基金合同生效日）至2025年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泓德中证A500指数增强A	泓德中证A500指数增强C	合计
泓德基金	0.00	4.93	4.93
广发证券	0.00	131,343.78	131,343.78
合计	0.00	131,348.71	131,348.71

注：支付基金销售机构的C类基金份额销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.40%的年费率每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付给泓德基金，再由泓德基金计算并支付给各基金销售机构。A类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：
日销售服务费=前一日C类基金份额基金资产净值×0.40%/当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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	本期
------	----

称	2025年03月11日（基金合同生效日）至2025年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
广发证券	9,188,922.60	580,616.73

注：本基金的银行存款由基金托管人广发证券存放在中国建设银行深圳宝安路支行，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2025年03月11日（基金合同生效日）至2025年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额
广发证券	688795	摩尔线程	公开发行	257	29,369.96
广发证券	688805	健信超导	公开发行	1,730	32,143.40

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2025年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688795	摩尔线程	2025-11-26	6个月以上	限售股	114.28	416.18	116	13,256.48	48,276.88	-
6888	沐曦	2025	6个月以	限售	104.6	399.3	82	8,58	32,74	-

02	股份	-12-09	上	股	6	1		2.12	3.42	
301656	联合动力	2025-09-17	6个月以上	限售股	12.48	25.46	1,137	14,189.76	28,948.02	-
301563	云汉芯城	2025-09-23	6个月以上	限售股	27.00	133.69	110	2,970.00	14,705.90	-
301584	建发致新	2025-09-18	6个月以上	限售股	7.05	26.82	447	3,151.35	11,988.54	-
688790	昂瑞微	2025-12-09	6个月以上	限售股	83.06	117.19	97	8,056.82	11,367.43	-
301638	南网数字	2025-11-11	6个月以上	限售股	5.69	14.21	660	3,755.40	9,378.60	-
688809	强一股份	2025-12-23	6个月以上	限售股	85.09	203.31	46	3,914.14	9,352.26	-
001386	马可波罗	2025-10-15	6个月以上	限售股	13.75	18.53	448	6,160.00	8,301.44	-
688807	优迅股份	2025-12-10	6个月以上	限售股	51.66	135.56	60	3,099.60	8,133.60	-
301668	昊创瑞通	2025-09-15	6个月以上	限售股	21.00	44.80	161	3,381.00	7,212.80	-
301667	纳百川	2025-12-10	6个月以上	限售股	22.63	57.07	118	2,670.34	6,734.26	-
301575	艾芬达	2025-09-03	6个月以上	限售股	27.69	49.55	126	3,488.94	6,243.30	-
688796	百奥赛图	2025-12-0	6个月以上	限售股	26.68	42.25	141	3,761.88	5,957.25	-

		2								
688805	健信超导	2025-12-17	6个月以上	限售股	18.58	32.37	173	3,214.34	5,600.01	-
001233	海安集团	2025-11-18	6个月以上	限售股	48.00	51.88	105	5,040.00	5,447.40	-
601026	道生天合	2025-10-09	6个月以上	限售股	5.98	14.28	358	2,140.84	5,112.24	-
603175	超颖电子	2025-10-17	6个月以上	限售股	17.08	48.56	101	1,725.08	4,904.56	-
688783	西安奕材	2025-10-20	6个月以上	限售股	8.62	18.36	263	2,267.06	4,828.68	-
001388	信通电子	2025-06-24	6个月以上	限售股	16.42	42.94	94	1,543.48	4,036.36	-
688759	必贝特	2025-10-21	6个月以上	限售股	17.78	25.11	141	2,506.98	3,540.51	-
603370	华新精科	2025-08-27	6个月以上	限售股	18.60	46.35	75	1,395.00	3,476.25	-
603376	大明电子	2025-10-28	6个月以上	限售股	12.55	26.21	111	1,393.05	2,909.31	-
603406	天富龙	2025-07-30	6个月以上	限售股	23.60	40.16	69	1,628.40	2,771.04	-
603418	友升股份	2025-09-16	6个月以上	限售股	46.36	59.06	46	2,132.56	2,716.76	-
001285	瑞立科密	2025-09-23	6个月以上	限售股	42.28	56.08	44	1,860.32	2,467.52	-

603092	德力佳	2025-10-30	6个月以上	限售股	46.68	55.66	44	2,053.92	2,449.04	-
688765	禾元生物	2025-10-16	6个月以上	限售股	29.06	52.62	45	1,307.70	2,367.90	-
603248	锡华科技	2025-12-16	6个月以上	限售股	10.10	16.30	140	1,414.00	2,282.00	-
603334	丰倍生物	2025-10-29	6个月以上	限售股	24.49	32.82	66	1,616.34	2,166.12	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
111024	澳弘转债	2025-12-12	1-6个月（含）	新债未上市	100.00	100.01	80	8,000.00	8,000.74	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。基金参与申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让，其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让。

7.4.12.2 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
002049	紫光国	2025-12-3	重大事	78.81	2026-01-15	86.69	9,300	722,838.58	732,933.00	-

	微	0	项							
688012	中微公司	2025-12-19	重大事项	272.72	2026-01-05	278.00	600	172,306.68	163,632.00	-

注：本基金截至2025年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本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，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。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“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的风险管理组织架构。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策等事项；督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中国证监会直接报告；在公司内部设立独立的监察稽核部，专职负责对基金管理人各部门、各业务的风险控制情况进行督促和检查，并适时提出整改建议。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去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同类风险损失的频度。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特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，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。

7.4.13.2 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。

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其他信用良好的境内商业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约可能性很小；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。

于本报告期期末，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(若有)占基金资产净值的比例为0.02%。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金严格按照相关法律法规要求、基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理，确保投资组合资产变现能力与投资者赎回需求保持动态平衡。

在资产端，本基金遵循组合管理、分散投资的基本原则，主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人对于基金持有资产的集中度、高流动性资产比例、流动性受限资产比例、逆回购分布等指标进行监控，定期开展压力测试，持续对投资组合流动性水平进行监测与评估。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，除在“7.4.12期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限的情况外（如有），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。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025年1 2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	12,951,964.31	-	-	-	12,951,964.31
交易性金融资产	-	-	44,467.70	151,621,972.31	151,666,440.01
应收申购款	-	-	-	17,790,271.44	17,790,271.44
资产总计	12,951,964.31	-	44,467.70	169,412,243.75	182,408,675.76
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,104,664.24	3,104,664.24
应付管理人报酬	-	-	-	101,612.59	101,612.59
应付托管费	-	-	-	19,052.36	19,052.36
应付销	-	-	-	31,050.82	31,050.82

售服务费					
其他负债	-	-	-	140,948.00	140,948.00
负债总计	-	-	-	3,397,328.01	3,397,328.01
利率敏感度缺口	12,951,964.31	-	44,467.70	166,014,915.74	179,011,347.75

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期期末，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券（若有）公允价值占基金资产净值的比例为0%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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，及时地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31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	151,621,972.31	84.70
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	44,467.70	0.02
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	151,666,440.01	84.72

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于本报告期期末，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。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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12月31日
第一层次	150,495,454.87
第二层次	904,565.74
第三层次	266,419.40
合计	151,666,440.01

7.4.14.2.2 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。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会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将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期		
	2025年03月11日（基金合同生效日）至2025年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	323,335.91	323,335.91
转出第三层次	-	24,500.56	24,500.56
当期利得或损失总额	-	-32,415.95	-32,415.95
其中：计入损益的利得或损失	-	-32,415.95	-32,415.95
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	266,419.40	266,419.40
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-41,339.12	-41,339.12

注：于2025年12月31日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于2025年3月11日（基金合同生效日）至2025年12月31日止期间，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	266,419.40	平均价格亚式期权模型	股价的预期年化波动率	18.00%-307.91%	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§8 投资组合报告

8.1 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	151,621,972.31	83.12
	其中：股票	151,621,972.31	83.12
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	44,467.70	0.02

	其中：债券	44,467.70	0.02
	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	12,951,964.31	7.10
8	其他各项资产	17,790,271.44	9.75
9	合计	182,408,675.76	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	655,794.00	0.37
B	采矿业	8,914,563.00	4.98
C	制造业	75,832,054.88	42.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,633,277.00	2.03
E	建筑业	2,028,657.00	1.13
F	批发和零售业	1,584,037.00	0.88
G	交通运输、仓储和邮政业	3,471,968.00	1.94
H	住宿和餐饮业	32,851.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,312,569.20	4.08
J	金融业	18,718,455.00	10.46
K	房地产业	1,326,705.00	0.74
L	租赁和商务服务业	1,897,402.00	1.06
M	科学研究和技术服务业	1,639,506.00	0.92
N	水利、环境和公共设施管理业	202,454.00	0.11

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	183,438.00	0.10
R	文化、体育和娱乐业	18,112.00	0.01
S	综合	47,103.00	0.03
	合计	127,498,946.08	71.22

8.2.2 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	469,843.00	0.26
C	制造业	17,811,226.91	9.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	269,744.00	0.15
E	建筑业	218,971.00	0.12
F	批发和零售业	575,167.44	0.32
G	交通运输、仓储和邮政业	420,809.00	0.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,530,662.26	0.86
J	金融业	831,507.00	0.46
K	房地产业	286,647.00	0.16
L	租赁和商务服务业	224,474.00	0.13
M	科学研究和技术服务业	414,376.62	0.23
N	水利、环境和公共设施管理业	150,710.00	0.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	248,712.00	0.14
Q	卫生和社会工作	170,240.00	0.10

R	文化、体育和娱乐业	488,064.00	0.27
S	综合	11,872.00	0.01
	合计	24,123,026.23	13.48

8.3 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

8.3.1 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	300750	宁德时代	15,200	5,582,352.00	3.12
2	601318	中国平安	63,800	4,363,920.00	2.44
3	600519	贵州茅台	2,900	3,993,822.00	2.23
4	601899	紫金矿业	104,300	3,595,221.00	2.01
5	300308	中际旭创	5,800	3,538,000.00	1.98
6	300502	新易盛	6,200	2,671,456.00	1.49
7	600036	招商银行	57,600	2,424,960.00	1.35
8	601166	兴业银行	110,100	2,318,706.00	1.30
9	300274	阳光电源	11,700	2,001,168.00	1.12
10	000333	美的集团	23,900	1,867,785.00	1.04
11	600900	长江电力	60,100	1,634,119.00	0.91
12	603259	药明康德	17,400	1,577,136.00	0.88
13	600887	伊利股份	48,200	1,378,520.00	0.77
14	601398	工商银行	169,100	1,340,963.00	0.75
15	600030	中信证券	43,500	1,248,885.00	0.70
16	300059	东方财富	48,100	1,114,958.00	0.62
17	601328	交通银行	153,100	1,109,975.00	0.62
18	688256	寒武纪	800	1,084,440.00	0.61
19	601600	中国铝业	85,300	1,042,366.00	0.58
20	002027	分众传媒	135,500	998,635.00	0.56
21	002594	比亚迪	9,700	947,884.00	0.53

22	600660	福耀玻璃	14,500	939,165.00	0.52
23	002475	立讯精密	16,200	918,702.00	0.51
24	000100	TCL科技	198,400	900,736.00	0.50
25	688981	中芯国际	7,202	884,621.66	0.49
26	603993	洛阳钼业	43,200	864,000.00	0.48
27	000792	盐湖股份	30,000	844,800.00	0.47
28	603501	豪威集团	6,700	843,530.00	0.47
29	000725	京东方 A	198,500	835,685.00	0.47
30	600941	中国移动	7,900	798,295.00	0.45
31	600019	宝钢股份	105,800	788,210.00	0.44
32	601288	农业银行	102,600	787,968.00	0.44
33	601857	中国石油	73,900	769,299.00	0.43
34	600989	宝丰能源	39,100	767,533.00	0.43
35	601211	国泰海通	36,200	743,910.00	0.42
36	600276	恒瑞医药	12,400	738,668.00	0.41
37	300124	汇川技术	9,800	738,234.00	0.41
38	002049	紫光国微	9,300	732,933.00	0.41
39	600050	中国联通	142,600	728,686.00	0.41
40	688041	海光信息	3,200	718,112.00	0.40
41	600795	国电电力	141,900	715,176.00	0.40
42	002415	海康威视	23,800	710,192.00	0.40
43	600406	国电南瑞	30,800	692,384.00	0.39
44	002236	大华股份	36,500	691,310.00	0.39
45	000338	潍柴动力	39,600	681,120.00	0.38
46	600346	恒力石化	29,700	669,141.00	0.37
47	002625	光启技术	13,700	668,012.00	0.37
48	300476	胜宏科技	2,300	661,434.00	0.37
49	600039	四川路桥	64,200	638,790.00	0.36
50	002371	北方华创	1,370	628,939.60	0.35
51	300033	同花顺	1,900	612,142.00	0.34
52	601988	中国银行	106,500	610,245.00	0.34

53	603019	中科曙光	7,100	608,044.00	0.34
54	002028	思源电气	3,900	602,901.00	0.34
55	601919	中远海控	39,000	592,020.00	0.33
56	300433	蓝思科技	19,400	587,238.00	0.33
57	600011	华能国际	77,600	578,896.00	0.32
58	002714	牧原股份	11,300	571,554.00	0.32
59	600096	云天化	16,900	564,629.00	0.32
60	600150	中国船舶	16,300	542,138.00	0.30
61	600690	海尔智家	20,700	540,063.00	0.30
62	601225	陕西煤业	24,500	522,340.00	0.29
63	002384	东山精密	6,100	516,365.00	0.29
64	601766	中国中车	75,400	514,228.00	0.29
65	601816	京沪高铁	97,700	503,155.00	0.28
66	600219	南山铝业	91,600	492,808.00	0.28
67	600547	山东黄金	12,700	491,617.00	0.27
68	601728	中国电信	76,900	484,470.00	0.27
69	000708	中信特钢	29,300	479,641.00	0.27
70	300628	亿联网络	13,300	474,145.00	0.26
71	600000	浦发银行	38,100	473,964.00	0.26
72	002001	新 和 成	18,600	468,534.00	0.26
73	600066	宇通客车	14,300	467,610.00	0.26
74	688072	拓荆科技	1,400	462,000.00	0.26
75	600309	万华化学	6,000	460,080.00	0.26
76	688002	睿创微纳	4,485	452,088.00	0.25
77	600183	生益科技	6,300	449,883.00	0.25
78	000858	五 粮 液	4,200	444,948.00	0.25
79	002156	通富微电	11,800	444,860.00	0.25
80	002841	视源股份	11,000	435,930.00	0.24
81	600988	赤峰黄金	13,700	427,988.00	0.24
82	601168	西部矿业	15,300	422,892.00	0.24
83	002463	沪电股份	5,700	416,499.00	0.23

84	600549	厦门钨业	10,100	414,706.00	0.23
85	000408	藏格矿业	4,900	413,560.00	0.23
86	601127	赛力斯	3,400	411,264.00	0.23
87	600938	中国海油	13,600	410,448.00	0.23
88	600031	三一重工	19,400	409,922.00	0.23
89	601601	中国太保	9,700	406,527.00	0.23
90	688009	中国通号	73,276	400,819.72	0.22
91	002074	国轩高科	10,200	398,922.00	0.22
92	002916	深南电路	1,710	397,215.90	0.22
93	601628	中国人寿	8,700	395,850.00	0.22
94	000733	振华科技	7,500	393,075.00	0.22
95	000063	中兴通讯	10,200	385,968.00	0.22
96	600415	小商品城	24,000	382,800.00	0.21
97	000301	东方盛虹	35,100	382,239.00	0.21
98	688008	澜起科技	3,200	376,960.00	0.21
99	000651	格力电器	9,300	374,046.00	0.21
100	601018	宁波港	102,900	373,527.00	0.21
101	688111	金山办公	1,200	368,484.00	0.21
102	601668	中国建筑	71,600	367,308.00	0.21
103	002414	高德红外	24,800	363,816.00	0.20
104	300442	润泽科技	6,600	348,480.00	0.19
105	600332	白云山	13,500	347,490.00	0.19
106	600362	江西铜业	6,300	345,996.00	0.19
107	001914	招商积余	31,700	338,556.00	0.19
108	001979	招商蛇口	37,600	324,864.00	0.18
109	002241	歌尔股份	11,300	324,649.00	0.18
110	688213	思特威	3,400	323,306.00	0.18
111	600489	中金黄金	13,700	320,032.00	0.18
112	601633	长城汽车	14,000	316,820.00	0.18
113	300604	长川科技	3,100	314,061.00	0.18
114	603806	福斯特	22,100	308,516.00	0.17

115	600418	江淮汽车	6,200	306,900.00	0.17
116	600741	华域汽车	15,300	306,000.00	0.17
117	600018	上港集团	56,300	305,146.00	0.17
118	300394	天孚通信	1,500	304,545.00	0.17
119	601319	中国人保	33,800	302,510.00	0.17
120	300014	亿纬锂能	4,600	302,496.00	0.17
121	000988	华工科技	3,800	301,454.00	0.17
122	002273	水晶光电	12,000	301,440.00	0.17
123	300454	深信服	2,600	299,416.00	0.17
124	300573	兴齐眼药	4,200	295,218.00	0.16
125	300017	网宿科技	28,500	292,125.00	0.16
126	300919	中伟新材	6,200	287,246.00	0.16
127	000426	兴业银锡	8,000	284,800.00	0.16
128	000157	中联重科	32,600	281,338.00	0.16
129	688223	晶科能源	49,800	280,872.00	0.16
130	002624	完美世界	16,300	267,157.00	0.15
131	603799	华友钴业	3,900	266,214.00	0.15
132	300058	蓝色光标	23,100	266,112.00	0.15
133	600312	平高电气	15,300	265,455.00	0.15
134	600998	九州通	51,200	262,144.00	0.15
135	000967	盈峰环境	35,500	260,570.00	0.15
136	000768	中航西飞	10,200	258,876.00	0.14
137	601117	中国化学	34,300	258,279.00	0.14
138	603486	科沃斯	3,200	258,176.00	0.14
139	600745	闻泰科技	6,900	257,232.00	0.14
140	300866	安克创新	2,200	251,658.00	0.14
141	002352	顺丰控股	6,400	245,248.00	0.14
142	002532	天山铝业	15,100	244,318.00	0.14
143	601872	招商轮船	27,000	242,460.00	0.14
144	002436	兴森科技	11,400	241,338.00	0.13
145	688120	华海清科	1,600	240,128.00	0.13

146	002460	赣锋锂业	3,800	238,982.00	0.13
147	002152	广电运通	17,300	238,913.00	0.13
148	002244	滨江集团	23,600	237,180.00	0.13
149	002230	科大讯飞	4,700	236,363.00	0.13
150	601390	中国中铁	43,400	234,794.00	0.13
151	603392	万泰生物	5,200	233,688.00	0.13
152	601658	邮储银行	42,500	231,625.00	0.13
153	688578	艾力斯	2,200	229,130.00	0.13
154	302132	中航成飞	2,900	229,100.00	0.13
155	300438	鹏辉能源	4,300	228,846.00	0.13
156	600803	新奥股份	11,000	228,360.00	0.13
157	601866	中远海发	90,400	227,808.00	0.13
158	002353	杰瑞股份	3,200	226,656.00	0.13
159	300413	芒果超媒	9,200	224,664.00	0.13
160	003816	中国广核	58,700	220,712.00	0.12
161	601100	恒立液压	2,000	219,820.00	0.12
162	002195	岩山科技	31,000	219,790.00	0.12
163	603939	益丰药房	10,100	219,372.00	0.12
164	600886	国投电力	16,700	219,104.00	0.12
165	002128	电投能源	7,700	214,907.00	0.12
166	600845	宝信软件	10,300	213,313.00	0.12
167	002648	卫星化学	11,900	210,392.00	0.12
168	600655	豫园股份	40,800	209,304.00	0.12
169	000568	泸州老窖	1,800	209,196.00	0.12
170	600007	中国国贸	10,500	208,110.00	0.12
171	600704	物产中大	37,200	207,204.00	0.12
172	601233	桐昆股份	12,000	206,520.00	0.12
173	002493	荣盛石化	17,600	206,096.00	0.12
174	002064	华峰化学	18,500	203,500.00	0.11
175	600153	建发股份	21,900	202,575.00	0.11
176	600352	浙江龙盛	18,900	201,474.00	0.11

177	000933	神火股份	7,300	200,531.00	0.11
178	600166	福田汽车	68,400	199,728.00	0.11
179	000975	山金国际	8,200	199,506.00	0.11
180	601058	赛轮轮胎	12,300	199,014.00	0.11
181	600176	中国巨石	11,500	196,650.00	0.11
182	600839	四川长虹	21,600	196,560.00	0.11
183	600009	上海机场	5,900	193,284.00	0.11
184	600196	复星医药	7,200	190,728.00	0.11
185	601021	春秋航空	3,200	190,400.00	0.11
186	605499	东鹏饮料	700	187,173.00	0.10
187	002456	欧菲光	17,600	186,912.00	0.10
188	002601	龙佰集团	9,500	186,010.00	0.10
189	002595	豪迈科技	2,200	185,922.00	0.10
190	600111	北方稀土	4,000	184,480.00	0.10
191	600026	中远海能	15,700	183,376.00	0.10
192	000066	中国长城	12,500	180,125.00	0.10
193	600535	天士力	11,900	179,333.00	0.10
194	600141	兴发集团	5,100	176,358.00	0.10
195	002138	顺络电子	4,900	174,097.00	0.10
196	600867	通化东宝	21,300	174,021.00	0.10
197	603986	兆易创新	800	171,400.00	0.10
198	600118	中国卫星	1,800	170,910.00	0.10
199	002245	蔚蓝锂芯	9,500	169,100.00	0.09
200	000932	华菱钢铁	29,700	166,914.00	0.09
201	601800	中国交建	20,100	165,624.00	0.09
202	600161	天坛生物	10,100	165,034.00	0.09
203	000630	铜陵有色	27,300	164,073.00	0.09
204	000818	航锦科技	8,500	164,050.00	0.09
205	688012	中微公司	600	163,632.00	0.09
206	002444	巨星科技	4,800	163,296.00	0.09
207	002050	三花智控	2,900	160,399.00	0.09

208	601618	中国中冶	52,200	155,034.00	0.09
209	002281	光迅科技	2,200	153,890.00	0.09
210	000938	紫光股份	6,200	152,520.00	0.09
211	600160	巨化股份	3,900	149,838.00	0.08
212	600482	中国动力	7,200	149,040.00	0.08
213	300003	乐普医疗	9,100	143,871.00	0.08
214	300015	爱尔眼科	13,100	143,838.00	0.08
215	000963	华东医药	3,600	142,020.00	0.08
216	300408	三环集团	3,100	141,825.00	0.08
217	601607	上海医药	7,900	141,094.00	0.08
218	300972	万辰集团	700	140,749.00	0.08
219	002179	中航光电	3,800	134,672.00	0.08
220	300760	迈瑞医疗	700	133,315.00	0.07
221	600511	国药股份	4,600	132,250.00	0.07
222	000807	云铝股份	4,000	131,360.00	0.07
223	000001	平安银行	11,100	126,651.00	0.07
224	601216	君正集团	26,200	126,284.00	0.07
225	688271	联影医疗	1,000	125,500.00	0.07
226	600760	中航沈飞	2,200	123,530.00	0.07
227	600522	中天科技	6,800	123,216.00	0.07
228	601877	正泰电器	4,400	122,716.00	0.07
229	688169	石头科技	800	121,648.00	0.07
230	600004	白云机场	12,800	121,088.00	0.07
231	688188	柏楚电子	880	119,583.20	0.07
232	688036	传音控股	1,800	119,088.00	0.07
233	601088	中国神华	2,900	117,450.00	0.07
234	002558	巨人网络	2,700	116,883.00	0.07
235	600497	驰宏锌锗	15,800	115,498.00	0.06
236	002155	湖南黄金	5,400	113,886.00	0.06
237	600585	海螺水泥	5,200	113,672.00	0.06
238	688005	容百科技	3,200	113,280.00	0.06

239	605117	德业股份	1,300	112,060.00	0.06
240	000831	中国稀土	2,400	111,456.00	0.06
241	300088	长信科技	18,100	109,686.00	0.06
242	601000	唐山港	28,500	109,440.00	0.06
243	600588	用友网络	8,200	108,732.00	0.06
244	601689	拓普集团	1,400	108,052.00	0.06
245	002091	江苏国泰	11,800	106,554.00	0.06
246	300803	指南针	800	104,696.00	0.06
247	300339	润和软件	2,100	103,950.00	0.06
248	600048	保利发展	16,900	103,090.00	0.06
249	000977	浪潮信息	1,500	99,900.00	0.06
250	600862	中航高科	4,200	99,246.00	0.06
251	603979	金诚信	1,300	98,995.00	0.06
252	603568	伟明环保	3,900	98,982.00	0.06
253	002517	恺英网络	4,500	98,415.00	0.05
254	000519	中兵红箭	5,300	96,513.00	0.05
255	601186	中国铁建	12,500	95,875.00	0.05
256	600104	上汽集团	6,100	92,842.00	0.05
257	300529	健帆生物	4,700	92,449.00	0.05
258	603606	东方电缆	1,500	89,625.00	0.05
259	603816	顾家家居	2,900	89,146.00	0.05
260	002422	科伦药业	3,000	88,050.00	0.05
261	300136	信维通信	1,400	86,800.00	0.05
262	600521	华海药业	5,100	86,547.00	0.05
263	000998	隆平高科	9,000	84,240.00	0.05
264	001965	招商公路	8,300	83,664.00	0.05
265	603129	春风动力	300	83,604.00	0.05
266	300457	赢合科技	3,000	83,550.00	0.05
267	002466	天齐锂业	1,500	83,070.00	0.05
268	002145	钛能化学	16,500	80,850.00	0.05
269	002266	浙富控股	19,300	80,288.00	0.04

270	002410	广联达	6,300	79,254.00	0.04
271	000738	航发控制	3,600	76,716.00	0.04
272	600486	扬农化工	1,100	76,329.00	0.04
273	002709	天赐材料	1,600	74,128.00	0.04
274	600580	卧龙电驱	1,500	73,650.00	0.04
275	000032	深桑达 A	3,800	73,530.00	0.04
276	603885	吉祥航空	4,800	71,424.00	0.04
277	002572	索菲亚	5,200	70,772.00	0.04
278	000039	中集集团	6,900	69,621.00	0.04
279	600089	特变电工	3,000	66,660.00	0.04
280	688506	百利天恒	200	64,620.00	0.04
281	002407	多氟多	1,900	64,429.00	0.04
282	688303	大全能源	2,400	64,368.00	0.04
283	601727	上海电气	7,300	62,853.00	0.04
284	300347	泰格医药	1,100	62,370.00	0.03
285	600038	中直股份	1,700	61,421.00	0.03
286	600028	中国石化	9,900	61,182.00	0.03
287	002252	上海莱士	9,500	60,230.00	0.03
288	000960	锡业股份	2,100	58,548.00	0.03
289	600177	雅戈尔	7,500	57,000.00	0.03
290	600563	法拉电子	500	52,475.00	0.03
291	300073	当升科技	900	52,020.00	0.03
292	603288	海天味业	1,400	51,828.00	0.03
293	300395	菲利华	500	50,150.00	0.03
294	603077	和邦生物	21,800	49,268.00	0.03
295	600208	衢州发展	12,700	49,149.00	0.03
296	688617	惠泰医疗	200	48,654.00	0.03
297	601888	中国中免	500	47,280.00	0.03
298	600673	东阳光	2,100	47,103.00	0.03
299	688608	恒玄科技	200	45,388.00	0.03
300	300832	新产业	800	45,000.00	0.03

301	600487	亨通光电	1,700	42,041.00	0.02
302	300751	迈为股份	200	41,198.00	0.02
303	300001	特锐德	1,600	41,088.00	0.02
304	000538	云南白药	700	39,732.00	0.02
305	002044	美年健康	7,500	39,600.00	0.02
306	688777	中控技术	800	39,472.00	0.02
307	002409	雅克科技	500	37,050.00	0.02
308	600325	华发股份	8,300	35,026.00	0.02
309	300450	先导智能	700	34,986.00	0.02
310	688126	沪硅产业	1,600	34,624.00	0.02
311	600754	锦江酒店	1,300	32,851.00	0.02
312	300390	天华新能	600	32,766.00	0.02
313	002837	英维克	300	32,067.00	0.02
314	002078	太阳纸业	2,000	31,500.00	0.02
315	600426	华鲁恒升	1,000	31,430.00	0.02
316	600895	张江高科	700	30,730.00	0.02
317	601006	大秦铁路	5,800	29,928.00	0.02
318	600885	宏发股份	980	29,792.00	0.02
319	300418	昆仑万维	700	29,190.00	0.02
320	002008	大族激光	700	28,833.00	0.02
321	002007	华兰生物	1,900	28,747.00	0.02
322	002812	恩捷股份	500	28,320.00	0.02
323	600699	均胜电子	900	28,224.00	0.02
324	002756	永兴材料	500	27,125.00	0.02
325	600674	川投能源	1,900	26,410.00	0.01
326	600085	同仁堂	800	25,808.00	0.01
327	601868	中国能建	10,700	25,145.00	0.01
328	600765	中航重机	1,300	24,908.00	0.01
329	002920	德赛西威	200	24,060.00	0.01
330	002472	双环传动	500	23,705.00	0.01
331	000034	神州数码	600	23,346.00	0.01

332	000035	中国天楹	4,200	23,184.00	0.01
333	688063	派能科技	400	22,728.00	0.01
334	300054	鼎龙股份	600	22,560.00	0.01
335	601012	隆基绿能	1,200	21,840.00	0.01
336	002129	TCL中环	2,400	20,568.00	0.01
337	603596	伯特利	400	20,508.00	0.01
338	603087	甘李药业	300	20,421.00	0.01
339	601238	广汽集团	2,500	20,400.00	0.01
340	000423	东阿阿胶	400	19,632.00	0.01
341	300724	捷佳伟创	200	19,120.00	0.01
342	301236	软通动力	400	18,972.00	0.01
343	002739	万达电影	1,600	18,112.00	0.01
344	600398	海澜之家	2,900	17,545.00	0.01
345	300627	华测导航	500	17,455.00	0.01
346	002318	久立特材	600	17,370.00	0.01
346	000425	徐工机械	1,500	17,370.00	0.01
347	600436	片仔癀	100	16,878.00	0.01
348	600637	东方明珠	1,700	16,745.00	0.01
349	601567	三星医疗	700	16,114.00	0.01
350	002738	中矿资源	200	15,710.00	0.01
351	601179	中国西电	1,700	15,470.00	0.01
352	300763	锦浪科技	200	14,282.00	0.01
353	600820	隧道股份	2,200	14,278.00	0.01
354	603605	珀莱雅	200	13,696.00	0.01
355	002340	格林美	1,600	13,376.00	0.01
356	301358	湖南裕能	200	12,932.00	0.01
357	601799	星宇股份	100	12,337.00	0.01
358	600008	首创环保	3,500	10,500.00	0.01
359	688166	博瑞医药	200	9,812.00	0.01
360	688472	阿特斯	600	8,946.00	0.00
361	603650	彤程新材	200	8,828.00	0.00

362	601966	玲珑轮胎	600	8,718.00	0.00
363	600392	盛和资源	400	8,612.00	0.00
364	002701	奥瑞金	1,200	7,140.00	0.00

8.3.2 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	300162	雷曼光电	65,600	533,328.00	0.30
2	603519	立霸股份	21,800	262,254.00	0.15
3	300219	鸿利智汇	35,800	258,118.00	0.14
4	603699	纽威股份	4,800	249,456.00	0.14
5	002367	康力电梯	28,500	229,710.00	0.13
6	002111	威海广泰	21,200	223,024.00	0.12
7	002905	金逸影视	19,000	214,700.00	0.12
8	300985	致远新能	11,700	214,695.00	0.12
9	300515	三德科技	10,900	214,294.00	0.12
10	603444	吉比特	500	211,925.00	0.12
11	603629	利通电子	7,900	210,535.00	0.12
12	688538	和辉光电	72,800	193,648.00	0.11
13	301186	超达装备	3,900	189,384.00	0.11
14	300543	朗科智能	17,000	189,040.00	0.11
15	600970	中材国际	18,100	188,059.00	0.11
16	000589	贵州轮胎	36,300	188,034.00	0.11
17	600469	风神股份	26,800	185,992.00	0.10
18	605138	盛泰集团	26,500	184,440.00	0.10
19	300746	汉嘉设计	14,500	183,715.00	0.10
20	002452	长高电新	22,200	182,706.00	0.10
21	688410	山外山	12,200	182,634.00	0.10
22	300239	东宝生物	30,900	181,074.00	0.10

23	603856	东宏股份	14,500	180,815.00	0.10
24	605098	行动教育	4,300	179,568.00	0.10
25	603231	索宝蛋白	9,800	179,536.00	0.10
26	300407	凯发电气	15,800	178,856.00	0.10
27	688677	海泰新光	4,123	177,948.68	0.10
28	002412	汉森制药	27,700	177,557.00	0.10
29	002598	山东章鼓	16,600	177,454.00	0.10
30	600057	厦门象屿	20,800	177,216.00	0.10
31	603116	红蜻蜓	27,500	168,575.00	0.09
32	003025	思进智能	11,400	163,818.00	0.09
33	300110	华仁药业	51,300	161,595.00	0.09
34	603551	奥普科技	13,700	158,783.00	0.09
35	002690	美亚光电	7,700	158,389.00	0.09
36	601616	广电电气	40,800	157,488.00	0.09
37	688589	力合微	6,800	154,700.00	0.09
38	688183	生益电子	1,600	153,104.00	0.09
39	002314	南山控股	52,800	150,480.00	0.08
40	301007	德迈仕	3,700	149,924.00	0.08
41	002956	西麦食品	5,300	149,036.00	0.08
42	600067	冠城新材	35,400	146,910.00	0.08
43	000895	双汇发展	5,500	145,585.00	0.08
44	300105	龙源技术	20,300	145,348.00	0.08
45	301239	普瑞眼科	4,400	144,716.00	0.08
46	300787	海能实业	12,100	142,175.00	0.08
47	600129	太极集团	7,600	137,180.00	0.08
48	603766	隆鑫通用	8,500	136,935.00	0.08
49	002913	奥士康	3,200	136,768.00	0.08
50	688191	智洋创新	4,232	136,185.76	0.08
51	002036	联创电子	12,300	135,546.00	0.08
52	601901	方正证券	17,300	134,940.00	0.08
53	688278	特宝生物	1,600	133,888.00	0.07

54	600725	云维股份	30,900	129,162.00	0.07
55	300369	绿盟科技	17,200	128,656.00	0.07
56	000528	柳 工	10,800	128,196.00	0.07
57	601121	宝地矿业	17,300	127,674.00	0.07
58	600919	江苏银行	12,100	125,840.00	0.07
59	301193	家联科技	5,800	125,106.00	0.07
60	300932	三友联众	10,400	124,696.00	0.07
61	600100	同方股份	13,800	123,096.00	0.07
62	000655	金岭矿业	12,800	121,600.00	0.07
63	605008	长鸿高科	8,300	118,441.00	0.07
64	300206	理邦仪器	9,200	117,668.00	0.07
65	301051	信濠光电	6,000	117,600.00	0.07
66	600935	华塑股份	47,600	116,620.00	0.07
67	688425	铁建重工	23,000	116,610.00	0.07
68	300358	楚天科技	11,900	116,501.00	0.07
69	603185	弘元绿能	3,800	115,900.00	0.06
70	600724	宁波富达	19,700	113,472.00	0.06
71	688509	正元地信	20,613	113,165.37	0.06
72	600488	津药药业	27,500	112,475.00	0.06
73	601963	重庆银行	10,300	111,549.00	0.06
74	002824	和胜股份	5,700	110,580.00	0.06
75	301500	飞南资源	7,000	109,830.00	0.06
76	002099	海翔药业	17,600	109,824.00	0.06
77	002678	珠江钢琴	20,500	109,265.00	0.06
78	601598	中国外运	18,000	109,080.00	0.06
79	688469	芯联集成	16,000	107,040.00	0.06
80	603912	佳力图	12,400	106,268.00	0.06
81	603170	宝立食品	7,400	105,672.00	0.06
82	300625	三雄极光	8,900	105,465.00	0.06
83	601333	广深铁路	34,600	105,184.00	0.06
84	002148	北纬科技	11,800	105,020.00	0.06

85	002137	实益达	12,200	104,676.00	0.06
86	603309	维力医疗	7,700	104,643.00	0.06
87	688636	智明达	2,400	102,816.00	0.06
88	002554	惠博普	32,000	102,080.00	0.06
89	300228	富瑞特装	10,300	101,867.00	0.06
90	600851	海欣股份	14,900	101,767.00	0.06
91	002950	奥美医疗	9,200	100,464.00	0.06
92	600479	千金药业	9,800	99,568.00	0.06
93	300048	合康新能	16,600	98,770.00	0.06
94	300381	溢多利	14,700	95,844.00	0.05
95	600873	梅花生物	9,300	94,209.00	0.05
96	601339	百隆东方	16,100	93,219.00	0.05
97	600819	耀皮玻璃	11,500	92,920.00	0.05
98	605266	健之佳	4,800	92,256.00	0.05
99	605066	天正电气	12,500	91,250.00	0.05
100	300317	珈伟新能	23,700	91,008.00	0.05
101	688079	美迪凯	8,022	90,809.04	0.05
102	603527	众源新材	8,100	89,829.00	0.05
103	688119	中钢洛耐	15,800	88,322.00	0.05
104	601229	上海银行	8,700	87,870.00	0.05
105	301380	挖金客	2,300	86,940.00	0.05
106	600379	宝光股份	7,200	83,952.00	0.05
107	002724	海洋王	12,300	83,394.00	0.05
108	300986	志特新材	7,400	82,732.00	0.05
109	301223	中荣股份	4,500	82,665.00	0.05
110	001322	箭牌家居	9,300	82,491.00	0.05
111	300212	易华录	4,600	80,270.00	0.04
112	603012	创力集团	13,000	78,520.00	0.04
113	000957	中通客车	6,800	77,656.00	0.04
114	603489	八方股份	2,500	76,450.00	0.04
115	002661	克明食品	8,300	75,862.00	0.04

116	603399	永杉锂业	7,300	75,847.00	0.04
117	688153	唯捷创芯	2,000	75,280.00	0.04
118	002688	金河生物	12,300	73,185.00	0.04
119	002587	奥拓电子	10,800	73,008.00	0.04
120	002022	科华生物	12,200	72,468.00	0.04
121	300583	赛托生物	5,200	71,188.00	0.04
122	300025	华星创业	12,100	69,696.00	0.04
123	605077	华康股份	4,700	69,466.00	0.04
124	300359	全通教育	12,900	69,144.00	0.04
125	605089	味知香	2,700	68,742.00	0.04
126	002899	英派斯	2,500	68,425.00	0.04
127	300656	民德电子	3,100	68,262.00	0.04
128	601019	山东出版	7,900	68,256.00	0.04
128	300798	锦鸡股份	9,600	68,256.00	0.04
129	601138	工业富联	1,100	68,255.00	0.04
130	600261	阳光照明	20,200	68,074.00	0.04
131	601999	出版传媒	9,700	66,639.00	0.04
132	002441	众业达	7,000	65,800.00	0.04
133	002293	罗莱生活	6,400	65,728.00	0.04
134	002184	海得控制	5,000	65,450.00	0.04
135	002758	浙农股份	6,400	64,448.00	0.04
136	000421	南京公用	9,200	63,572.00	0.04
137	300187	永清环保	13,000	63,310.00	0.04
138	688576	西山科技	1,000	62,960.00	0.04
139	300824	北鼎股份	5,500	62,205.00	0.03
140	002333	罗普斯金	11,000	61,820.00	0.03
141	603558	健盛集团	5,500	61,765.00	0.03
142	601900	南方传媒	4,600	61,686.00	0.03
143	688211	中科微至	2,000	61,600.00	0.03
144	002311	海大集团	1,100	60,918.00	0.03
145	600848	上海临港	5,200	60,840.00	0.03

146	603112	华翔股份	3,400	59,058.00	0.03
147	000931	中 关 村	12,000	58,440.00	0.03
148	605058	澳弘电子	1,900	57,988.00	0.03
149	601991	大唐发电	16,400	57,236.00	0.03
150	300448	浩云科技	7,300	57,159.00	0.03
151	688391	钜泉科技	2,000	56,660.00	0.03
152	601066	中信建投	2,100	56,217.00	0.03
153	000529	广弘控股	9,000	54,090.00	0.03
154	603380	易德龙	1,400	53,200.00	0.03
155	600716	凤凰股份	13,700	53,019.00	0.03
156	300789	唐源电气	2,300	52,900.00	0.03
157	300562	乐心医疗	3,900	51,987.00	0.03
158	002852	道道全	4,900	51,695.00	0.03
159	603586	金麒麟	2,700	51,516.00	0.03
160	601137	博威合金	2,400	51,288.00	0.03
161	600876	凯盛新能	5,200	51,272.00	0.03
162	300447	全信股份	2,800	50,624.00	0.03
163	002142	宁波银行	1,800	50,562.00	0.03
164	301299	卓创资讯	900	48,942.00	0.03
165	000789	万年青	9,300	48,639.00	0.03
166	688795	摩尔线程	116	48,276.88	0.03
167	600335	国机汽车	7,300	47,523.00	0.03
168	301596	瑞迪智驱	600	47,172.00	0.03
169	000600	建投能源	5,500	46,915.00	0.03
170	600262	北方股份	1,800	46,854.00	0.03
171	600419	天润乳业	4,700	46,530.00	0.03
172	300005	探路者	4,200	45,486.00	0.03
173	002790	瑞尔特	5,400	45,306.00	0.03
174	300241	瑞丰光电	8,100	45,279.00	0.03
175	600378	昊华科技	1,400	44,744.00	0.02
176	001238	浙江正特	900	44,460.00	0.02

177	688281	华秦科技	600	44,280.00	0.02
178	688208	道通科技	1,200	44,160.00	0.02
179	300755	华致酒行	2,500	44,050.00	0.02
180	002560	通达股份	4,300	43,344.00	0.02
181	601336	新华保险	600	41,820.00	0.02
182	603429	集友股份	4,200	41,622.00	0.02
183	688187	时代电气	800	41,032.00	0.02
184	603010	万盛股份	3,900	41,028.00	0.02
185	601865	福莱特	2,600	40,742.00	0.02
186	688061	灿瑞科技	1,226	39,979.86	0.02
187	300139	晓程科技	1,300	39,468.00	0.02
188	603391	力聚热能	600	39,282.00	0.02
189	300365	恒华科技	6,100	38,552.00	0.02
190	000959	首钢股份	7,600	37,240.00	0.02
191	301160	翔楼新材	500	35,945.00	0.02
192	601777	千里科技	3,300	35,079.00	0.02
193	601636	旗滨集团	5,900	34,987.00	0.02
194	688802	沐曦股份	82	32,743.42	0.02
195	603897	长城科技	1,200	32,640.00	0.02
196	601825	沪农商行	3,500	32,515.00	0.02
197	300389	艾比森	2,000	32,460.00	0.02
198	688362	甬矽电子	1,000	32,410.00	0.02
199	002823	凯中精密	2,000	32,120.00	0.02
200	300882	万胜智能	1,700	31,960.00	0.02
201	601555	东吴证券	3,500	31,710.00	0.02
202	300999	金龙鱼	1,100	31,614.00	0.02
203	300040	九洲集团	5,200	31,304.00	0.02
204	300533	冰川网络	900	31,257.00	0.02
205	603167	渤海轮渡	3,300	31,119.00	0.02
206	300435	中泰股份	1,400	31,108.00	0.02
207	603886	元祖股份	2,200	30,734.00	0.02

208	300560	中富通	1,900	30,704.00	0.02
209	300453	三鑫医疗	3,500	30,520.00	0.02
210	600182	S佳通	2,000	30,340.00	0.02
211	002884	凌霄泵业	1,700	30,073.00	0.02
212	603043	广州酒家	1,700	29,971.00	0.02
213	688088	虹软科技	600	29,700.00	0.02
213	603529	爱玛科技	1,000	29,700.00	0.02
214	000923	河钢资源	1,400	29,638.00	0.02
215	301656	联合动力	1,137	28,948.02	0.02
216	603697	有友食品	2,300	28,175.00	0.02
217	300115	长盈精密	600	27,900.00	0.02
218	300363	博腾股份	1,200	27,888.00	0.02
219	600818	中路股份	2,900	27,811.00	0.02
220	603020	爱普股份	2,700	27,378.00	0.02
221	300720	海川智能	800	27,112.00	0.02
222	600713	南京医药	4,700	25,662.00	0.01
223	603882	金域医学	900	25,524.00	0.01
224	603055	台华新材	2,700	25,488.00	0.01
225	002600	领益智造	1,600	24,864.00	0.01
226	300550	和仁科技	1,700	24,667.00	0.01
227	002935	天奥电子	1,100	24,585.00	0.01
228	002238	天威视讯	3,000	24,390.00	0.01
229	603235	天新药业	900	24,273.00	0.01
230	000726	鲁泰A	3,400	24,208.00	0.01
231	002331	皖通科技	2,700	24,084.00	0.01
232	300909	汇创达	500	24,050.00	0.01
233	000900	现代投资	5,800	23,722.00	0.01
234	002216	三全食品	2,100	23,709.00	0.01
235	300864	南大环境	1,200	23,664.00	0.01
235	002443	金洲管道	2,900	23,664.00	0.01
236	603066	音飞储存	2,200	23,650.00	0.01

237	603357	设计总院	2,900	23,635.00	0.01
238	600662	外服控股	4,700	23,594.00	0.01
239	002686	亿利达	3,600	23,544.00	0.01
240	301587	中瑞股份	1,000	23,400.00	0.01
241	603896	寿仙谷	1,200	23,256.00	0.01
242	688127	蓝特光学	600	23,094.00	0.01
243	600928	西安银行	6,200	22,940.00	0.01
244	300296	利亚德	3,600	22,752.00	0.01
245	603609	禾丰股份	3,200	22,688.00	0.01
246	000828	东莞控股	2,100	22,596.00	0.01
247	688786	悦安新材	800	22,568.00	0.01
248	002860	星帅尔	1,600	22,560.00	0.01
249	600237	铜峰电子	2,500	22,400.00	0.01
250	600266	城建发展	4,400	22,308.00	0.01
251	600801	华新水泥	900	22,086.00	0.01
252	601107	四川成渝	3,600	21,888.00	0.01
253	688372	伟测科技	200	21,818.00	0.01
254	600958	东方证券	2,000	21,800.00	0.01
255	688772	珠海冠宇	1,000	21,530.00	0.01
256	688510	航亚科技	800	21,520.00	0.01
257	301310	鑫宏业	500	21,475.00	0.01
258	601698	中国卫通	600	21,438.00	0.01
259	600997	开滦股份	3,700	21,275.00	0.01
260	600560	金自天正	1,300	21,242.00	0.01
261	601688	华泰证券	900	21,231.00	0.01
262	688700	东威科技	600	21,168.00	0.01
263	603999	读者传媒	3,000	21,090.00	0.01
264	300484	蓝海华腾	1,100	20,955.00	0.01
265	002430	杭氧股份	700	20,909.00	0.01
266	603008	喜临门	1,000	20,480.00	0.01
267	002322	理工能科	1,704	20,465.04	0.01

268	301201	诚达药业	500	20,350.00	0.01
269	601156	东航物流	1,100	20,251.00	0.01
270	300279	和晶科技	2,800	20,216.00	0.01
271	300559	佳发教育	1,600	20,176.00	0.01
272	601811	新华文轩	1,500	20,130.00	0.01
273	688595	芯海科技	600	19,680.00	0.01
274	000552	甘肃能化	8,500	19,635.00	0.01
275	600020	中原高速	4,600	19,596.00	0.01
276	603070	万控智造	1,500	19,440.00	0.01
277	300639	凯普生物	3,600	19,368.00	0.01
278	000885	城发环境	1,400	19,208.00	0.01
279	301100	风光股份	900	19,179.00	0.01
280	301052	果麦文化	500	19,095.00	0.01
281	688683	莱尔科技	600	19,020.00	0.01
282	603987	康德莱	2,200	18,920.00	0.01
283	301516	中远通	1,200	18,732.00	0.01
284	605166	聚合顺	1,800	18,666.00	0.01
285	601898	中煤能源	1,500	18,660.00	0.01
286	688375	国博电子	200	18,622.00	0.01
287	002759	天际股份	400	18,572.00	0.01
288	000543	皖能电力	2,300	18,285.00	0.01
289	688055	龙腾光电	5,070	18,252.00	0.01
290	002080	中材科技	500	18,170.00	0.01
291	688248	南网科技	400	17,896.00	0.01
292	603815	交建股份	2,400	17,856.00	0.01
293	002962	五方光电	1,200	17,784.00	0.01
294	002726	龙大美食	4,300	17,673.00	0.01
295	603628	清源股份	1,300	17,550.00	0.01
296	688386	泛亚微透	200	17,520.00	0.01
297	301263	泰恩康	600	17,394.00	0.01
298	000062	深圳华强	700	17,234.00	0.01

299	600809	山西汾酒	100	17,170.00	0.01
300	002337	赛象科技	2,600	17,082.00	0.01
301	603588	高能环境	2,200	16,984.00	0.01
302	601518	吉林高速	6,000	16,920.00	0.01
303	300857	协创数据	100	16,868.00	0.01
304	000657	中钨高新	600	16,626.00	0.01
305	002343	慈文传媒	2,300	16,468.00	0.01
306	688522	纳睿雷达	400	15,972.00	0.01
307	603889	新澳股份	2,000	15,900.00	0.01
308	002768	国恩股份	300	15,804.00	0.01
309	300349	金卡智能	1,000	15,630.00	0.01
310	600926	杭州银行	1,000	15,280.00	0.01
311	603969	银龙股份	1,500	15,165.00	0.01
312	603967	中创物流	1,100	15,103.00	0.01
313	601939	建设银行	1,600	14,848.00	0.01
314	301563	云汉芯城	110	14,705.90	0.01
315	002033	丽江股份	1,600	14,640.00	0.01
316	300475	香农芯创	100	14,434.00	0.01
317	688131	皓元医药	200	14,416.00	0.01
318	300548	长芯博创	100	14,200.00	0.01
319	601330	绿色动力	2,100	14,133.00	0.01
320	600908	无锡银行	2,300	13,639.00	0.01
321	300983	尤安设计	500	13,400.00	0.01
322	301090	华润材料	1,900	13,376.00	0.01
323	300774	倍杰特	700	13,300.00	0.01
324	605376	博迁新材	200	13,080.00	0.01
325	601886	江河集团	1,600	13,056.00	0.01
326	300719	安达维尔	700	12,677.00	0.01
327	601881	中国银河	800	12,576.00	0.01
328	601009	南京银行	1,100	12,573.00	0.01
329	603858	步长制药	800	12,512.00	0.01

330	600817	宇通重工	1,100	12,507.00	0.01
331	300667	必创科技	700	12,376.00	0.01
332	603239	浙江仙通	600	12,306.00	0.01
333	605399	晨光新材	900	12,168.00	0.01
334	600084	中信尼雅	2,300	12,075.00	0.01
335	301060	兰卫医学	1,300	12,025.00	0.01
336	301584	建发致新	447	11,988.54	0.01
337	600834	申通地铁	1,400	11,872.00	0.01
338	002986	宇新股份	1,100	11,836.00	0.01
339	600350	山东高速	1,200	11,700.00	0.01
340	603303	得邦照明	900	11,601.00	0.01
341	600796	钱江生化	1,900	11,514.00	0.01
342	605599	菜百股份	700	11,459.00	0.01
343	002918	蒙娜丽莎	800	11,384.00	0.01
344	688790	昂瑞微	97	11,367.43	0.01
345	300818	耐普矿机	300	11,361.00	0.01
346	600315	上海家化	500	11,260.00	0.01
347	003007	直真科技	300	11,187.00	0.01
348	688768	容知日新	257	11,164.08	0.01
349	688007	光峰科技	600	11,142.00	0.01
350	000020	深华发 A	800	11,096.00	0.01
351	300191	潜能恒信	600	11,088.00	0.01
352	300193	佳士科技	1,200	10,740.00	0.01
353	688315	诺禾致源	800	10,624.00	0.01
354	002350	北京科锐	1,300	10,582.00	0.01
355	002548	金新农	1,700	10,336.00	0.01
356	601528	瑞丰银行	1,800	10,260.00	0.01
357	300863	卡倍亿	200	10,080.00	0.01
358	300318	博晖创新	1,600	10,032.00	0.01
359	300956	英力股份	600	9,984.00	0.01
360	002835	同为股份	600	9,828.00	0.01

361	600098	广州发展	1,500	9,810.00	0.01
362	603788	宁波高发	600	9,804.00	0.01
363	300384	三联虹普	600	9,750.00	0.01
364	688459	哈铁科技	1,000	9,650.00	0.01
365	300868	杰美特	300	9,510.00	0.01
366	301638	南网数字	660	9,378.60	0.01
367	688809	强一股份	46	9,352.26	0.01
368	600292	远达环保	700	9,135.00	0.01
369	688090	瑞松科技	200	8,896.00	0.00
370	603165	荣晟环保	700	8,855.00	0.00
371	301391	卡莱特	100	8,485.00	0.00
372	300991	创益通	200	8,436.00	0.00
373	001386	马可波罗	448	8,301.44	0.00
374	688807	优迅股份	60	8,133.60	0.00
375	301068	大地海洋	300	7,896.00	0.00
376	301138	华研精机	200	7,760.00	0.00
377	300314	戴维医疗	600	7,548.00	0.00
378	301668	昊创瑞通	161	7,212.80	0.00
379	300811	铂科新材	100	7,131.00	0.00
380	603719	良品铺子	600	7,026.00	0.00
381	301307	美利信	200	6,916.00	0.00
382	000166	申万宏源	1,300	6,851.00	0.00
383	001216	华瓷股份	400	6,844.00	0.00
384	301667	纳百川	118	6,734.26	0.00
385	603989	艾华集团	400	6,712.00	0.00
386	000709	河钢股份	2,900	6,699.00	0.00
387	603687	大胜达	700	6,671.00	0.00
388	601878	浙商证券	600	6,486.00	0.00
389	000822	山东海化	1,200	6,300.00	0.00
390	301575	艾芬达	126	6,243.30	0.00
391	002396	星网锐捷	200	6,060.00	0.00

392	688796	百奥赛图	141	5,957.25	0.00
393	300375	鹏翎股份	1,100	5,786.00	0.00
394	688805	健信超导	173	5,600.01	0.00
395	001233	海安集团	105	5,447.40	0.00
396	601026	道生天合	358	5,112.24	0.00
397	603175	超颖电子	101	4,904.56	0.00
398	688783	西安奕材	263	4,828.68	0.00
399	600078	澄星股份	500	4,795.00	0.00
400	001380	华纬科技	200	4,576.00	0.00
401	301535	浙江华远	200	4,380.00	0.00
402	001388	信通电子	94	4,036.36	0.00
403	688759	必贝特	141	3,540.51	0.00
404	603370	华新精科	75	3,476.25	0.00
405	000553	安道麦A	600	3,288.00	0.00
406	603376	大明电子	111	2,909.31	0.00
407	603406	天富龙	69	2,771.04	0.00
408	603418	友升股份	46	2,716.76	0.00
409	001285	瑞立科密	44	2,467.52	0.00
410	603092	德力佳	44	2,449.04	0.00
411	688620	安凯微	200	2,408.00	0.00
412	688765	禾元生物	45	2,367.90	0.00
413	603248	锡华科技	140	2,282.00	0.00
414	603334	丰倍生物	66	2,166.12	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	19,204,274.00	10.73

2	300750	宁德时代	13,116,556.40	7.33
3	601318	中国平安	11,033,926.00	6.16
4	600036	招商银行	9,692,342.00	5.41
5	601899	紫金矿业	7,948,379.00	4.44
6	601166	兴业银行	7,814,771.00	4.37
7	000333	美的集团	6,938,529.00	3.88
8	601398	工商银行	6,717,604.00	3.75
9	600900	长江电力	5,897,287.00	3.29
10	002594	比亚迪	5,865,524.00	3.28
11	000651	格力电器	5,733,971.00	3.20
12	300502	新易盛	5,463,062.00	3.05
13	000725	京东方 A	5,251,015.00	2.93
14	601328	交通银行	5,156,140.00	2.88
15	600030	中信证券	4,890,154.00	2.73
16	002415	海康威视	4,811,760.00	2.69
17	603501	豪威集团	4,811,052.15	2.69
18	601601	中国太保	4,758,830.00	2.66
19	600887	伊利股份	4,723,376.00	2.64
20	600919	江苏银行	4,656,574.00	2.60
21	601728	中国电信	4,564,562.00	2.55
22	600000	浦发银行	4,494,700.00	2.51
23	002027	分众传媒	4,464,093.00	2.49
24	601988	中国银行	4,456,048.00	2.49
25	000100	TCL科技	4,451,812.00	2.49
26	000425	徐工机械	4,374,635.00	2.44
27	601288	农业银行	4,302,991.00	2.40
28	002475	立讯精密	4,130,319.00	2.31
29	600031	三一重工	3,975,050.00	2.22
30	603259	药明康德	3,971,126.00	2.22
31	300059	东方财富	3,808,811.88	2.13
32	600039	四川路桥	3,740,776.00	2.09

33	601600	中国铝业	3,722,472.00	2.08
34	000858	五 粮 液	3,660,192.00	2.04
35	600028	中国石化	3,639,699.00	2.03
36	300308	中际旭创	3,600,885.00	2.01

8.4.2 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	600519	贵州茅台	14,724,433.00	8.23
2	300750	宁德时代	9,982,738.00	5.58
3	601318	中国平安	7,944,998.00	4.44
4	600036	招商银行	7,355,100.00	4.11
5	601899	紫金矿业	6,234,418.00	3.48
6	601166	兴业银行	5,686,261.00	3.18
7	601398	工商银行	5,673,765.00	3.17
8	000333	美的集团	5,408,544.00	3.02
9	000651	格力电器	5,316,804.00	2.97
10	300502	新易盛	5,051,679.86	2.82
11	600919	江苏银行	4,963,942.00	2.77
12	002594	比亚迪	4,722,686.00	2.64
13	000425	徐工机械	4,473,506.00	2.50
14	601601	中国太保	4,462,434.58	2.49
15	600900	长江电力	4,366,429.00	2.44
16	600000	浦发银行	4,364,570.00	2.44
17	000725	京东方 A	4,357,324.00	2.43
18	601328	交通银行	4,124,122.00	2.30
19	601288	农业银行	4,017,011.00	2.24
20	002415	海康威视	3,975,031.00	2.22
21	603501	豪威集团	3,956,338.00	2.21

22	601728	中国电信	3,883,706.00	2.17
23	601988	中国银行	3,878,705.00	2.17
24	600030	中信证券	3,733,984.00	2.09
25	002027	分众传媒	3,614,040.00	2.02
26	600031	三一重工	3,609,933.00	2.02
27	600028	中国石化	3,591,809.00	2.01

8.4.3 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	1,047,735,830.24
卖出股票收入（成交）总额	940,040,125.11

注：本项中8.4.1、8.4.2、8.4.3表中的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
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)	44,467.70	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	44,467.70	0.02

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113699	金25转债	150	26,167.69	0.01
2	111024	澳弘转债	80	8,000.74	0.00
3	113695	华辰转债	40	6,416.22	0.00
4	123257	安克转债	17	2,704.14	0.00
5	123259	锦浪转02	8	1,178.91	0.00

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期末未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策
本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券除招商银行（证券代码：600036）、兴业银行（证券代码：601166）外，其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2025年09月12日，招商银行（证券代码：600036）发行人招商银行股份有限公司因数据安全管理工作不到位被国家金融监督管理总局警告并罚款60万元。

2025年12月05日，兴业银行（证券代码：601166）发行人兴业银行股份有限公司因外包机构管理不到位、企业划型不准确被国家金融监督管理总局罚款720万元。

在上述公告公布后，本基金管理人对上述公司进行了进一步了解和视为，认为上述处罚不会对投资价值构成实质性负面影响，因此本基金管理人对上述公司的投资判断未发生改变。本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合本基金管理人投资管理制度的规定。

8.12.2 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。

8.12.3 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	17,790,271.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,790,271.44

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113695	华辰转债	6,416.22	0.00
2	123257	安克转债	2,704.14	0.00

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
泓德 中证A 500指 数增 强A	697	75,834.47	8,249,684.98	15.6 1%	44,606,941.23	84.39%
泓德 中证A 500指 数增 强C	1,4 36	61,731.53	2,849,848.95	3.21%	85,796,622.21	96.79%
合计	2,1 15	66,904.54	11,099,533.93	7.84%	130,403,563.44	92.16%

注：机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

9.3 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	泓德中证A500指数增强A	0
	泓德中证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	泓德中证A500指数增强A	0
	泓德中证A500指数增强C	0
	合计	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	泓德中证A500指数增强A	泓德中证A500指数增强C
基金合同生效日(2025年03月11日)基金份额总额	223,494,536.04	253,415,963.66
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	38,923,667.31	178,527,132.39
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	209,561,577.14	343,296,624.89
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	52,856,626.21	88,646,471.16

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 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

（1）基金管理人的重大人事变动

2025年3月27日，本基金管理人发布《泓德基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，王德晓担任公司首席信息官（兼），童良发退休离任公司副总经理兼首席信息官。

2025年7月12日，本基金管理人发布《泓德基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，李娇担任公司督察长，不再担任公司副总经理；李晓春退休离任公司督察长。

（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,不存在基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金基金管理人、基金财产以及基金托管人基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金基金合同生效日起安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务至今，本报告期内会计师事务所未发生改变。报告期内本基金应支付给会计师事务所的报酬为40,000.00元。目前事务所已为本基金提供审计服务的连续年限为1年。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期未发生公司被中国证监会、基金业协会、证券交易所施以重大处罚或公开谴责，以及被财政、外汇和审计等部门施以重大处罚的情况。

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，未发生管理人高级管理人员及其他从业人员受调查或处罚的情况。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无受调查或处罚等情况。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门相关从业人员无受调查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
金融街证券	3	1,561,754,570.80	78.60%	290,339.89	78.59%	-
国联民生证券	2	425,251,946.21	21.40%	79,118.95	21.41%	-

- 注：1、本基金采用券商结算模式，本报告期内管理人选择国联民生证券、金融街证券作为证券经纪商。
- 2、本基金采用证券公司交易结算模式，可免于执行《关于完善证券投资基金交易席位有关问题的通知》中关于交易佣金分仓的规定。
- 3、基金专用交易单元的选择标准如下：
- （1）该证券机构经营行为规范，内控制度健全；
 - （2）财务状况良好，公司经营状况稳定；
 - （3）具有基金投资运作所需的证券服务能力和水平。
- 4、基金专用交易单元的选择程序如下：
- （1）本基金管理人根据上述标准考察后选定证券经营机构；
 - （2）基金管理人和被选中的证券经营机构签订协议。

11.7.2 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		基金交易	
	成交金额	占当期债	成交金额	占当期债	成交金额	占当期权	成交金额	占当期基

		券成交总 额的比例		券回购成 交总额的 比例		证成交总 额的比例		金成交总 额的比例
金融街证券	247.71	100.00%	-	-	-	-	-	-
国联民生证 券	-	-	-	-	-	-	-	-

11.8 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	泓德中证A500指数增强型证券投资基金基金份额发售公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2025-02-08
2	泓德基金管理有限公司关于泓德中证A500指数增强型证券投资基金新增北京汇成基金销售有限公司为销售机构的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2025-02-19
3	泓德基金管理有限公司关于泓德中证A500指数增强型证券投资基金新增上海好买基金销售有限公司为销售机构的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2025-02-25
4	泓德中证A500指数增强型证券投资基金基金合同生效公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2025-03-12
5	泓德基金管理有限公司关于泓德中证A500指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2025-04-08
6	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华西证券股份有限公司为销售机构的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2025-04-25
7	泓德基金管理有限公司关于	公司官网、证券时报、中国	2025-06-24

	旗下部分基金增加方正证券股份有限公司为销售机构的公告	证监会基金电子披露网站	
8	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加西南证券股份有限公司为销售机构的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2025-06-27
9	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加腾安基金销售（深圳）有限公司为销售机构的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2025-06-27
10	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国泰海通证券股份有限公司为销售机构的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2025-08-28
11	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中国人寿保险股份有限公司为销售机构的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2025-09-05
12	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加玄元保险代理有限公司为销售机构的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2025-10-23
13	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中国邮政储蓄银行股份有限公司为销售机构的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2025-11-12
14	泓德基金管理有限公司关于暂停首创证券股份有限公司办理泓德中证A500指数增强型证券投资基金相关销售业务的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2025-11-12
15	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加深圳前海	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2025-11-19

	微众银行股份有限公司为销售机构的公告		
16	泓德基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2025-11-27
17	泓德基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2025-12-18

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准泓德中证A500指数增强型证券投资基金设立的文件；
- 2、《泓德中证A500指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《泓德中证A500指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《泓德中证A500指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在规定报刊上披露的各项公告。

13.2 存放地点

地点为管理人地址：北京市西城区德胜门外大街125号

13.3 查阅方式

- 1、投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件
- 2、投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人泓德基金管理有限公司，客户服务电话：4009-100-888

3、投资者可访问本基金管理人公司网站，网址：www.hongdefund.com

泓德基金管理有限公司
二〇二六年三月二十八日