

# 华富中证 A500 指数型证券投资基金 2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人：华富基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2026 年 3 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 3 月 30 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。

本报告期自 2025 年 8 月 19 日（基金合同生效日）起至 2025 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	16
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>17</b>
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>19</b>
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	22
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>45</b>
8.1 期末基金资产组合情况	45
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46

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 .....	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	59
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	61
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 .....	61
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 .....	61
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 .....	61
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 .....	61
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	61
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	61
8.12 投资组合报告附注 .....	61
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>62</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	62
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	63
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 .....	63
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>63</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>64</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	64
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 .....	64
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	64
11.4 基金投资策略的改变 .....	64
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	65
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....	65
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	65
11.8 其他重大事件 .....	66
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>67</b>
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 .....	67
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	68
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>68</b>
13.1 备查文件目录 .....	68
13.2 存放地点 .....	68
13.3 查阅方式 .....	68

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华富中证 A500 指数型证券投资基金	
基金简称	华富中证 A500 指数	
基金主代码	023331	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 8 月 19 日	
基金管理人	华富基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	101,675,503.65 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华富中证 A500 指数 A	华富中证 A500 指数 C
下属分级基金的交易代码	023331	023332
报告期末下属分级基金的份额总额	62,166,056.14 份	39,509,447.51 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金主要采用完全复制法进行投资，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。在正常情况下，本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的预期日均跟踪偏离度的绝对值小于 0.35%，预期年化跟踪误差不超过 4%。本基金的港股通标的股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、国债期货交易策略、股指期货交易策略、参与融资及转融通证券出借业务策略、存托凭证投资策略详见招募说明书等法律文件。
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	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数类似的风险收益特征。本基金如果投资港股通标的股票，还可能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	华富基金管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 姓名	林之懿	朱萍

负责人	联系电话	021-68886996	021-31888888
	电子邮箱	linzy@hffund.com	zhup02@spdb.com.cn
客户服务电话		400-700-8001	95528
传真		021-68887997	021-63602540
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区栖霞路 26 弄 1 号 3 层、4 层	上海市中山东一路 12 号
办公地址		上海市浦东新区栖霞路 18 号陆家嘴富汇大厦 A 座 3 楼、5 楼	上海市博成路 1388 号浦银中心 A 栋
邮政编码		200120	200126
法定代表人		余海春	张为忠

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.hffund.com">http://www.hffund.com</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26
注册登记机构	华富基金管理有限公司	上海市浦东新区栖霞路 18 号陆家嘴富汇大厦 A 座 3 楼、5 楼

## § 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	2025 年 8 月 19 日（基金合同生效日） - 2025 年 12 月 31 日	
	华富中证 A500 指数 A	华富中证 A500 指数 C
本期已实现收益	4,010,265.12	2,409,315.10
本期利润	4,203,108.63	2,091,174.56
加权平均基金份额本期利润	0.0385	0.0332
本期加权平均净值利润率	3.81%	3.29%
本期基金份额净值增长率	2.68%	2.53%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末	

期末可供分配利润	1,665,776.53	998,512.51
期末可供分配基金份额利润	0.0268	0.0253
期末基金资产净值	63,831,832.67	40,507,960.02
期末基金份额净值	1.0268	1.0253
3.1.3 累计期末指标	2025 年末	
基金份额累计净值增长率	2.68%	2.53%

注：1) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2) 以上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（例如，开放式基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华富中证 A500 指数 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	-0.28%	0.99%	0.43%	1.00%	-0.71%	-0.01%
自基金合同生效起至今	2.68%	0.84%	11.40%	1.06%	-8.72%	-0.22%

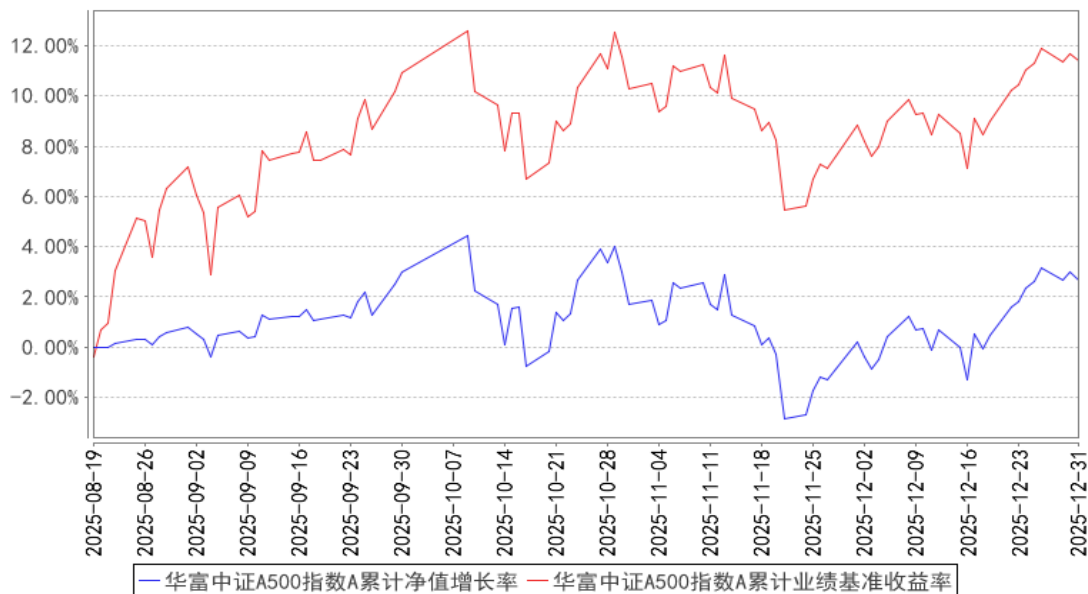
华富中证 A500 指数 C

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	-0.38%	0.99%	0.43%	1.00%	-0.81%	-0.01%
自基金合同生效起至今	2.53%	0.84%	11.40%	1.06%	-8.87%	-0.22%

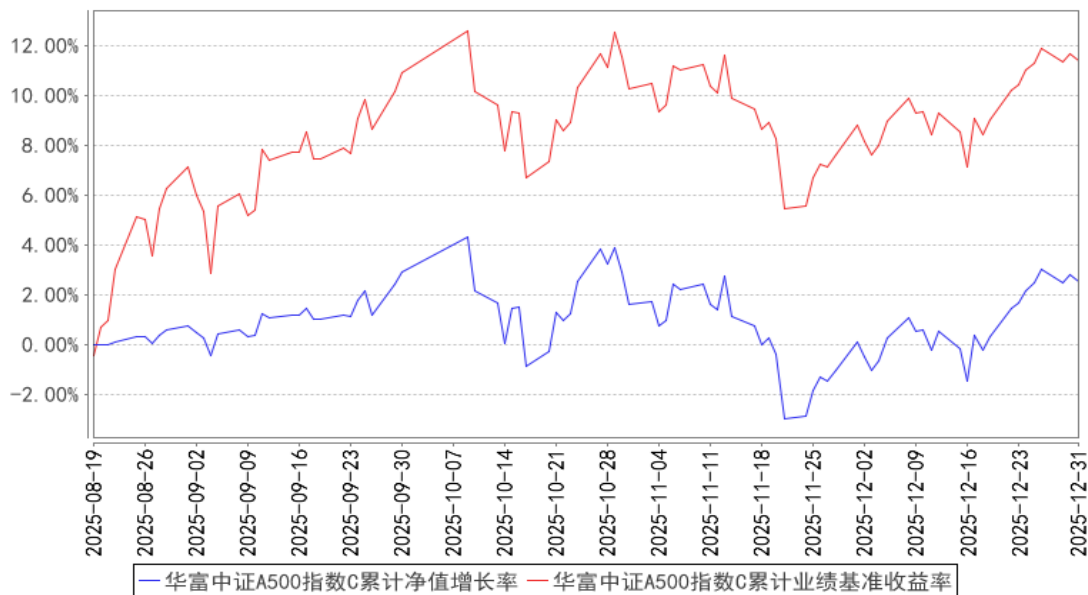
注：业绩比较基准收益率=中证 A500 指数收益率\*95%+银行活期存款利率（税后）\*5%

### 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

华富中证A500指数A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



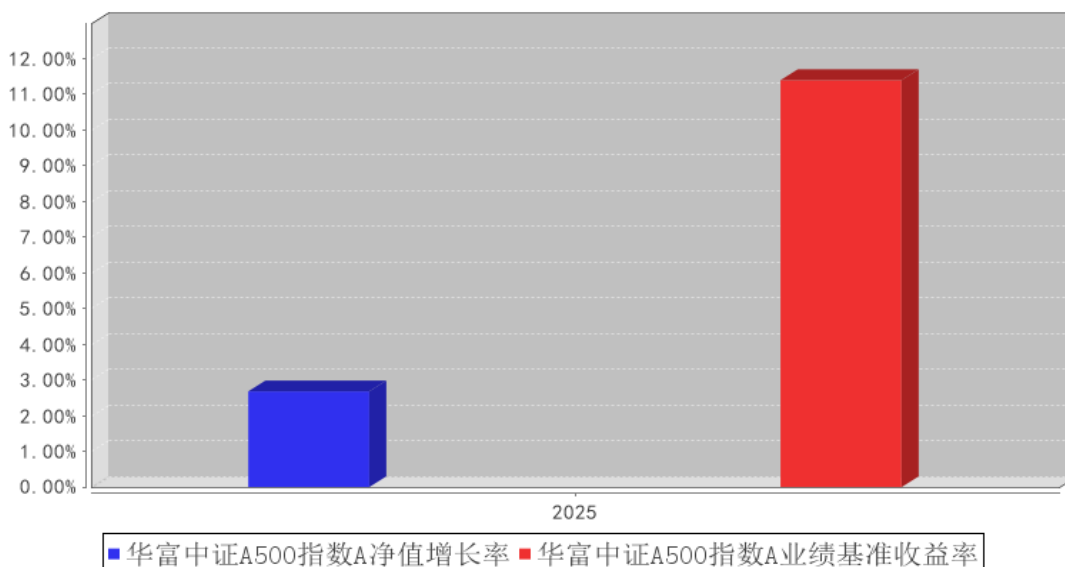
华富中证A500指数C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



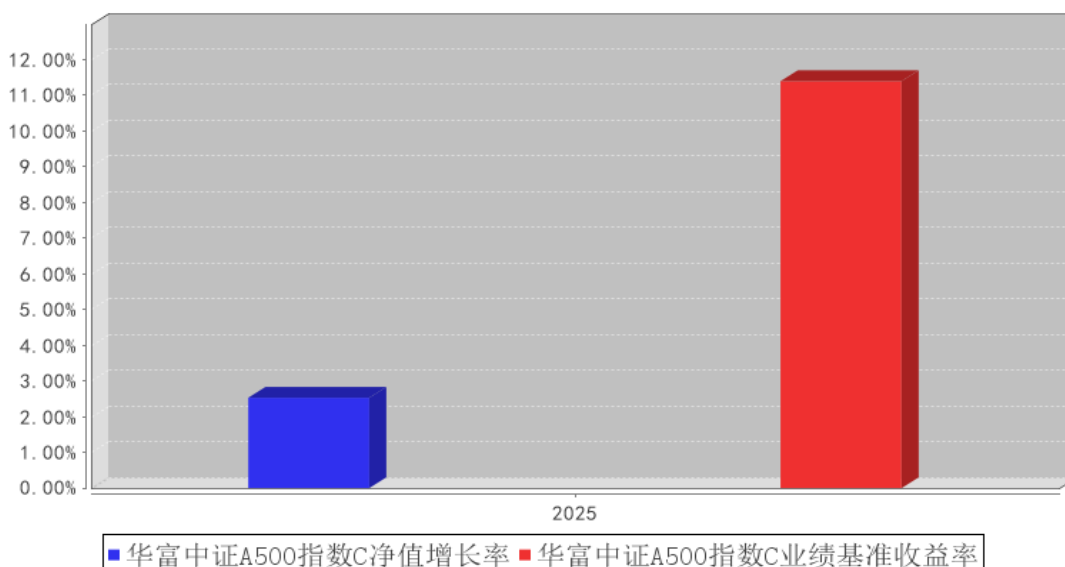
注：截至本报告披露日，本基金的基金合同生效未满一年。本基金建仓期为 2025 年 8 月 19 日到 2026 年 2 月 19 日。本报告期内，本基金仍在建仓期。

### 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

华富中证A500指数A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



华富中证A500指数C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不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

注：本基金过去三年未进行利润分配。

## § 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

基金管理人华富基金管理有限公司于 2004 年 3 月 29 日经中国证监会证监基金字[2004]47 号

文核准开业，4月19日在上海正式注册成立。注册资本2.5亿元，公司股东为华安证券股份有限公司、安徽省信用融资担保集团有限公司和合肥兴泰金融控股（集团）有限公司。截止2025年12月31日，本基金管理人管理了华富竞争力优选混合型证券投资基金、华富货币市场基金、华富成长趋势混合型证券投资基金、华富收益增强债券型证券投资基金、华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金、华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金、华富强化回报债券型证券投资基金、华富量子生命力混合型证券投资基金、华富中小企业100指数增强型证券投资基金、华富安鑫债券型证券投资基金、华富灵活配置混合型证券投资基金、华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金、华富恒稳纯债债券型证券投资基金、华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金、华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金、华富恒利债券型证券投资基金、华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金、华富安享债券型证券投资基金、华富安福债券型证券投资基金、华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富天益货币市场基金、华富天盈货币市场基金、华富产业升级灵活配置混合型证券投资基金、华富富瑞3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华富可转债债券型证券投资基金、华富恒盛纯债债券型证券投资基金、华富中证5年恒定久期国开债指数型证券投资基金、华富恒欣纯债债券型证券投资基金、华富安兴39个月定期开放债券型证券投资基金、华富科技动能混合型证券投资基金、华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金、华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华富成长企业精选股票型证券投资基金、华富中债-安徽省公司信用类债券指数证券投资基金、华富63个月定期开放债券型证券投资基金、华富安华债券型证券投资基金、华富中证证券公司先锋策略交易型开放式指数证券投资基金、华富新能源股票型发起式证券投资基金、华富中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金、华富中债1-3年国开行债券指数证券投资基金、华富安盈一年持有期债券型证券投资基金、华富吉丰60天滚动持有中短债债券型证券投资基金、华富富惠一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华富卓越成长一年持有期混合型证券投资基金、华富中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、华富匠心明选一年持有期混合型证券投资基金、华富富鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华富安业一年持有期债券型证券投资基金、华富消费成长股票型证券投资基金、华富中证科创创业50指数增强型证券投资基金、华富时代锐选混合型证券投资基金、华富吉富30天滚动持有中短债债券型证券投资基金、华富匠心领航18个月持有期混合型证券投资基金、华富数字经济混合型证券投资基金、华富荣盛一年持有期混合型证券投资基金、华富吉禄90天滚动持有债券型证券投资基金、华富泰合平衡3个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、华富恒享纯债债券型证券投资基金、华富恒惠纯债债券型证券投

资基金、华富半导体产业混合型发起式证券投资基金、华富祥晖 6 个月持有期债券型证券投资基金、华富中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金、华富鼎信 3 个月持有期债券型基金中基金（FOF）、华富中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华富中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金、华富新华中诚信红利价值指数型证券投资基金、华富吉福 120 天滚动持有债券型证券投资基金、华富中证港股通创新药指数型发起式证券投资基金、华富华证沪深港汽车制造主题指数型发起式证券投资基金、华富祥康 12 个月持有期债券型证券投资基金、华富富润 6 个月封闭运作债券型证券投资基金、华富中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华富沪深 300 指数增强型证券投资基金、华富富源三个月持有期债券型证券投资基金、华富医疗创新混合型发起式证券投资基金、华富中证 A500 指数型证券投资基金、华富安顺一年持有期债券型证券投资基金、华富福盛一年持有期混合型证券投资基金、华富安康三个月持有期债券型证券投资基金、华富安和债券型证券投资基金、华富富泽六个月持有期债券型证券投资基金、华富安颐九个月持有期债券型证券投资基金、华富裕诚一年持有期债券型证券投资基金、华富天华货币市场基金共八十七只基金。

#### 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		
李孝华	本基金基金经理、指数投资部权益指数经理	2025 年 8 月 19 日	-	十二年	南开大学经济学硕士、硕士研究生学历。历任金瑞期货研究所贵金属研究员、国泰信息技术有限公司量化投资平台设计与开发员、华泰柏瑞基金管理有限公司基金经理助理。2019 年 10 月加入华富基金管理有限公司，曾任基金经理助理，自 2021 年 6 月 28 日起任华富中证证券公司先锋策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 8 月 11 日起任华富中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 11 月 17 日起任华富中小企业 100 指数增强型证券投资基金基金经理，自 2022 年 9 月 5 日起任华富灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2023 年 2 月 9 日起任华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2023 年 2 月 9 日起任华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，自 2023 年 3 月 24 日起任华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经

					理, 自 2025 年 1 月 15 日起任华富中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 自 2025 年 2 月 18 日起任华富中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理, 自 2025 年 4 月 29 日起任华富中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 自 2025 年 5 月 7 日起任华富新华中诚信红利价值指数型证券投资基金基金经理, 自 2025 年 6 月 10 日起任华富华证沪深港汽车制造主题指数型发起式证券投资基金基金经理, 自 2025 年 7 月 25 日起任华富中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理, 自 2025 年 8 月 19 日起任华富中证 A500 指数型证券投资基金基金经理, 具有基金从业资格。
张娅	本基金基金经理、公司总经理助理、指数投资部总监、公司公募投资决策委员会委员	2025 年 8 月 19 日	-	二十一年	美国肯特州立大学理学硕士, 硕士研究生学历。历任华泰柏瑞基金管理有限公司指数投资部总监兼基金经理、上海同安投资管理有限公司副总经理兼宏观量化中心总经理。2017 年 4 月加入华富基金管理有限公司, 自 2019 年 1 月 28 日起任华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券投资基金基金经理, 自 2019 年 12 月 24 日起任华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 自 2020 年 4 月 23 日起任华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理, 自 2020 年 8 月 3 日起任华富中债-安徽省公司信用类债券指数证券投资基金基金经理, 自 2022 年 8 月 31 日起任华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金基金经理, 自 2025 年 5 月 7 日起任华富新华中诚信红利价值指数型证券投资基金基金经理, 自 2025 年 8 月 19 日起任华富中证 A500 指数型证券投资基金基金经理, 具有基金从业资格。

注: 1、上述任职日期为根据公司决定确定的聘任日期, 离任日期为根据公司决定确定的解聘日期; 首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、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，本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法律法规，对本基金的管理始终按照基金合同、招募说明书的要求和公司制度的规定进行。本基金的交易行为合法合规，未发现异常情况；相关信息披露真实、完整、准确、及时；基金各种账户类、申购赎回、注册登记业务均按规定的程序进行，未出现重大违法违规或违反基金合同的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华富基金管理有限公司公平交易管理制度》，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，公司的公平交易制度所规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。具体控制措施如下：

在研究分析和投资决策环节，公司通过建立规范、完善的研究管理平台，为所有的投资组合经理提供公平的研究服务和支持。公司的各类投资组合，在保证其决策相对独立的同时，在获取投资信息、投资建议及决策实施方面均享有公平的机会。各投资组合经理根据其管理的投资组合的投资风格和投资策略，制定客观、完整的交易决策规则，并按照这些规则进行投资决策，保证各投资组合投资决策的客观性和独立性。

在交易执行环节，公司设立独立的集中交易部门，通过实行集中交易制度和公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。交易执行的公平原则：“价格优先、时间优先、综合平衡、比例实施”，保证交易在各投资组合间的公正实施，保证各投资组合间的利益公平对待。公司通过完善银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易的交易分配制度，确保各投资组合获得公平的交易机会。

在行为监控和分析评估环节，公司将公平交易作为日常交易监控的重要关注内容，加强对投资交易行为的监督力度，公司集中交易部、风险管理部等相关部门严格按照公司关于异常交易的界定规则对违反公平交易原则的异常交易进行识别、监控与分析。每日交易时间结束后，集中交易部对每一笔公平交易的执行结果进行登记，逐笔备注发生公平交易各指令的先后顺序及实际执行结果，由具体执行的交易员签字确认留档，并交风险管理部备案。公司风险管理部分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如 1 日内、3 日内、5 日内）同向交易的交易价差进行分析。本报告期内，根据纳入样本内的数据分析结果，未发现明显异常情况。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法规要求，结合实际情况，制定了《华富基金管理有限公司公平交易管理制度》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节全部纳入公平交易管理中，实行事前控制、事中监控、事后分析反馈的流程化管理。在制度和流程上确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金报告期内不存在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超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

## 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

2025 年 A 股资本市场虽然面临全球地缘政治局势、美国对等关税等外部不确定性因素干扰，但在政策的强力呵护和以 AI 为代表的科技产业趋势的引领下，A 股展现出了非常强的韧性。全年沪深 300、中证 500、中证 1000 分别上涨 17.66%、30.39%、27.49%。整体偏暖的市场氛围催生了 AI 产业链、创新药、有色、商业航天等各类结构性投资机会。从各行业表现来看，2025 年涨幅居前的行业为有色金属、通信、电子，表现靠后的行业为食品饮料、煤炭、美容护理、公用事业等内需型资产及红利方向。从市场风格看，小盘整体优于大盘，成长强于价值，市场风险偏好相对较高。

本基金跟踪的中证 A500 作为 A 股市场的新一代代表性宽基，其表现与市场整体基本同步。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本期末，华富中证 A500 指数 A 份额净值为 1.0268 元，累计份额净值为 1.0268 元。报告期，华富中证 A500 指数 A 份额净值增长率为 2.68%，同期业绩比较基准收益率为 11.40%。截止本期末，华富中证 A500 指数 C 份额净值为 1.0253 元，累计份额净值为 1.0253 元。报告期，华富中证 A500 指数 C 份额净值增长率为 2.53%，同期业绩比较基准收益率为 11.40%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着市场整体重心逐渐抬升，预计 2026 年市场分化将有所加大，我们在保持对后市整体乐观的同时也宜适当降低预期。华富中证 A500 指数作为紧密跟踪中证 A500 指数的被动基金，未来将继续严格遵守基金合同，跟踪好标的指数，以期为投资者提供合理的投资回报。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2025 年度，为加强公司内部控制，监察稽核工作从制度建设和内部监察稽核入手为公司持续发展奠定坚实的基础。公司监察稽核部门按照规定的权限和程序，独立、客观、公正地开展基金运作和公司管理的合规性监察，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

1、继续建立和完善架构清晰、控制有效的内部控制机制。2025 年为明确董事会议事规则及决策机制，修订了《“三重一大”决策制度实施办法》与《董事会议事规则》；为进一步规范公司债券投资行为，加强债券信用风险管理，对《固定收益投资管理规定》《债券信用评级管理规定》《债券池管理规定》进行了修订；为忠实履行基金管理人的诚信义务，防范利益输送，进一步完善《华富基金管理有限公司旗下基金投资关联方证券管理制度》；为加强新股网下申购业务的规范运作，制定了《新股询价与网下申购业务管理规定》；根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，制订了《货币经纪服务管理规定》；为加强公司旗下投资组合公平交易管理，修订了《异常交易监控与报告管理规定》；为了规范公司代表旗下基金参与上市公司治理相关行为，助力提升上市公司治理质量，依据《公开募集证券投资基金管理人参与上市公司治理管理规则》，修订了《旗下基金参与上市公司治理管理规定》；为有效发挥互联网平台在公司品牌形象、业务发展、企业文化建设、意识形态建设等方面的作用，进一步规范公司直播业务，制定了《基金直播业务管理规定》与《互联网平台管理规定》；为促进公司健康发展，保护投资者合法权益，加强公司内部廉洁从业管理，实现持续规范发展，保障公司依法合规、稳健经营，根据《基金经营机构及其工作人员廉洁从业实施细则》，修订了《廉洁从业管理制度》。

2、多方位开展监察稽核工作，不断提高稽核覆盖面和检查力度。通过定期和不定期监察稽核工作的开展，公司的各个部门、各项业务的规范性和完善性都得到了较大的提高，各部门及时发现和弥补了制度建设中的漏洞和缺陷，实际业务操作流程更加科学有效。

3、加强风险监控，严格控制投资风险，通过对各基金的运行状况、投资比例、相关指标进行监控和跟踪，及时报告异常情况，确保基金投资规范运作。

4、扩大风险控制工作的覆盖面。风险控制工作不再局限于投资管理，从公司运营整体规范要求，风险控制渗透在业务的各个环节和所有部门，由风险控制委员会组织、监察稽核部及风险管理部执行，识别和评估从治理结构到一线业务操作等公司各方面、各业务流程中公司运作和基金管理的风险点和风险程度，明确划分风险责任，并制定相应的风险控制措施。

在今后的工作中，本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，提高内部监察稽核工作的科学

性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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》等法律法规、估值指引的相关规定，以及基金合同对估值程序的相关约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值的账务处理、基金份额净值的计算由基金管理人独立完成，并与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和基金合同要求以及基金实际运作情况，本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 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，本基金不存在连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对华富中证 A500 指数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》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 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，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对华富中证 A500 指数型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在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

本报告期内，由华富基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、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 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	容诚审字[2026]200Z0650 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	华富中证 A500 指数型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了华富中证 A500 指数型证券投资基金财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年 8 月 19 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。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了华富中证 A500 指数型证券投资基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年 8 月 19 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。</p>
形成审计意见的基础	<p>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职业道德守则和中国注册会计师独立性准则，我们独立于华富中证 A500 指数型证券投资基金，并遵守了独立性准则中适用于公众利益实体财务报表审计的规定，同时履行了职业道德方面的其他责任。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。</p>
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	<p>华富中证 A500 指数型证券投资基金的基金管理人华富基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括华富中证 A500 指数型证券投资基金 2025 年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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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</p>

	<p>要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，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。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估华富中证 A500 指数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，除非基金管理人管理层计划清算华富中证 A500 指数型证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督华富中证 A500 指数型证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>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。</p> <p>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：</p> <p>（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。</p> <p>（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。</p> <p>（3）评价基金管理人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。</p> <p>（4）对基金管理人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，就可能对导致对华富中证 A500 指数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华富中证 A500 指数型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报、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。</p> <p>我们与基金管理人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</p>

	别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	陈邈迤	贺斯吴仪
会计师事务所的地址	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26	
审计报告日期	2026 年 3 月 30 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华富中证 A500 指数型证券投资基金

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
<b>资产：</b>		
货币资金	7.4.7.1	10,703,039.85
结算备付金		2,673,419.24
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	98,430,367.08
其中：股票投资		98,430,367.08
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	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		34,966.04
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.5	-
资产总计		111,841,792.21
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		
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		7,269,993.30

应付管理人报酬		48,432.87
应付托管费		9,686.55
应付销售服务费		14,600.63
应付投资顾问费		-
应交税费		2.17
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.6	159,284.00
负债合计		7,501,999.52
<b>净资产：</b>		
实收基金	7.4.7.7	101,675,503.65
未分配利润	7.4.7.8	2,664,289.04
净资产合计		104,339,792.69
负债和净资产总计		111,841,792.21

注：本基金合同于 2025 年 8 月 19 日生效，无上年度末数据。报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额总额 101,675,503.65 份，其中华富中证 A500 指数 A 基金份额总额 62,166,056.14 份，基金份额净值 1.0268 元；华富中证 A500 指数 C 基金份额总额 39,509,447.51 份，基金份额净值 1.0253 元。

## 7.2 利润表

会计主体：华富中证 A500 指数型证券投资基金

本报告期：2025 年 8 月 19 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 8 月 19 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		6,932,400.78
1. 利息收入		180,116.09
其中：存款利息收入	7.4.7.9	176,903.24
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		3,212.85
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		6,873,378.61
其中：股票投资收益	7.4.7.10	6,277,511.25
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.11	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-

股利收益	7.4.7.15	595,867.36
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-125,297.03
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	4,203.11
<b>减：二、营业总支出</b>		638,117.59
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	319,176.95
2. 托管费	7.4.10.2.2	63,835.39
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	93,135.22
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	7.4.7.18	-
7. 税金及附加		0.23
8. 其他费用	7.4.7.19	161,969.80
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		6,294,283.19
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		6,294,283.19
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-
<b>六、综合收益总额</b>		6,294,283.19

注：本基金合同于 2025 年 8 月 19 日生效，无上年度可比期间。

### 7.3 净资产变动表

会计主体：华富中证 A500 指数型证券投资基金

本报告期：2025 年 8 月 19 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 8 月 19 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 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	-	-	-	-
二、本期期初净资产	263,318,599.06	-	-	263,318,599.06
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	- 161,643,095.41	-	2,664,289.04	-158,978,806.37
（一）、综合收益总额	-	-	6,294,283.19	6,294,283.19

(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)	-	-	-3,629,994.15	-165,273,089.56
其中：1. 基金申购款	161,643,095.41	-	152,437.72	9,610,500.02
2. 基金赎回款	-	-	-3,782,431.87	-174,883,589.58
(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	101,675,503.65	-	2,664,289.04	104,339,792.69

注：本基金合同于 2025 年 8 月 19 日生效，无上年度可比期间。

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：

<u>余海春</u>	<u>曹华玮</u>	<u>束庆斌</u>
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

华富中证 A500 指数型证券投资基金（以下简称本基金或基金）经中国证监会 2025 年证监许可【2025】49 号核准，基金合同于 2025 年 8 月 19 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集资金到位情况经容诚会计师事务所（特殊普通合伙）审验，并出具《验资报告》（容诚验字【2025】200Z0123 号）。有关基金设立文件已按规定向中国证券监督管理委员会备案。本基金的管理人为华富基金管理有限公司，基金份额登记机构为华富基金管理有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《华富中证 A500 指数型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股、备选成份股、其他国内依法发行上市的股票（非标的指数成份股及其备选成份股，包括主板、科创板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会允许上

市的股票)、港股通标的股票、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券、央行票据、中期票据、地方政府债券、政府支持债券、政府支持机构债券、短期融资券(含超短期融资券)等)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括银行定期存款、银行协议存款、银行通知存款等)、国债期货、股指期货、货币市场工具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的相关规定)。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照企业会计准则及其应用指南、准则解释及其他相关规定(包括《资产管理产品相关会计处理规定》)(以下统称企业会计准则)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、基金合同和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本基金财务报表以持续经营为编制基础。

#### 7.4.3 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,同时参照中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》和中国证监会允许的基金行业实务操作,真实、完整地反映了基金的财务状况、经营成果和净资产变动等有关信息。

#### 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。本期会计报表的实际编制期间为 2025 年 8 月 19 日至 2025 年 12 月 31 日。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币;记账本位币单位为元。

##### 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：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和以摊余成本计量的金融负债。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。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、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（若预期存续期少于 12 个月，则为预期存续期内）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

本基金持有的金融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基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分或折算日根据拆分或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算确认。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。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1)现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2)实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

#### 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(若有)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

1、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的收益分配方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

2、同一类别的每一基金份额享有同等分配权；本基金各基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同；

3、在符合以下有关基金分红条件的情形下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以届时的公告为准：

(1) 本基金可每季度对基金相对业绩比较基准的超额收益率以及基金的可供分配利润进行评价，当收益评价日核定的基金份额净值增长率超过业绩比较基准同期增长率或者基金可供分配利润金额大于零时，本基金可进行收益分配；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 当基金收益分配根据基金相对业绩比较基准的超额收益率决定时，基于本基金的特点，本基金收益分配无需以弥补亏损为前提，收益分配后各类基金份额净值有可能低于面值；当基金收益分配根据基金可供分配利润金额决定时，本基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、本基金可以根据实际情况在其他日期进行收益评价，在符合上述有关基金分红条件的情形下，本基金可进行收益分配；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 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入账。

外币货币性项目，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汇兑损益科目。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。

#### 7.4.4.13 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。

#### 7.4.4.14 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，本基金确定以下以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产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和债券，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、市盈率法、现金流量折现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

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

注：根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会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[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《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》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会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》、财税[2016]140号《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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：（1）资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。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，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。（2）对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。（3）对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登

记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。（4）基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。（5）本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

### 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	10,703,039.85
等于：本金	10,702,503.58
加：应计利息	536.27
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	10,703,039.85

#### 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	98,555,664.11	-	98,430,367.08	-125,297.03
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	98,555,664.11	-	98,430,367.08	-125,297.03

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：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

注：无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

7.4.7.5 其他资产

注：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	-
应付审计费	18,900.00
其他	384.00
应付信息披露费	140,000.00
合计	159,284.00

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

华富中证 A500 指数 A

项目	本期
----	----

	2025 年 8 月 19 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	167,083,180.90	167,083,180.90
本期申购	4,744,376.02	4,744,376.02
本期赎回（以“-”号填列）	-109,661,500.78	-109,661,500.78
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	62,166,056.14	62,166,056.14

华富中证 A500 指数 C

项目	本期 2025 年 8 月 19 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	96,235,418.16	96,235,418.16
本期申购	4,713,686.28	4,713,686.28
本期赎回（以“-”号填列）	-61,439,656.93	-61,439,656.93
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	39,509,447.51	39,509,447.51

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

华富中证 A500 指数 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	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	4,010,265.12	192,843.51	4,203,108.63
本期基金份额交易产生的变动数	-1,116,219.63	-1,421,112.47	-2,537,332.10
其中：基金申购款	79,061.15	209.36	79,270.51
基金赎回款	-1,195,280.78	-1,421,321.83	-2,616,602.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,894,045.49	-1,228,268.96	1,665,776.53

华富中证 A500 指数 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	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	2,409,315.10	-318,140.54	2,091,174.56
本期基金份额交易产	-630,584.34	-462,077.71	-1,092,662.05

生的变动数			
其中：基金申购款	76,125.11	-2,957.90	73,167.21
基金赎回款	-706,709.45	-459,119.81	-1,165,829.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,778,730.76	-780,218.25	998,512.51

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2025年8月19日（基金合同生效日）至2025年12月31日	
活期存款利息收入		24,797.29
定期存款利息收入		-
其他存款利息收入		-
结算备付金利息收入		152,105.95
其他		-
合计		176,903.24

注：“其他”包含结算保证金利息收入及认申购款利息收入。

#### 7.4.7.10 股票投资收益

##### 7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2025年8月19日（基金合同生效日）至2025年12月31日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		6,277,511.25
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		6,277,511.25

##### 7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2025年8月19日（基金合同生效日）至2025年12月31日	
卖出股票成交总额		211,208,554.36
减：卖出股票成本总额		204,696,815.44
减：交易费用		234,227.67
买卖股票差价收入		6,277,511.25

7.4.7.10.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

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

注：无。

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

7.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

7.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2025 年 8 月 19 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	595,867.36
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	595,867.36

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025 年 8 月 19 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-125,297.03
股票投资	-125,297.03
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	-125,297.03

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 8 月 19 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	4,203.11
合计	4,203.11

#### 7.4.7.18 信用减值损失

注：无。

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 8 月 19 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
审计费用	18,900.00
信息披露费	140,000.00
证券出借违约金	-

银行费用	2,669.80
其他	400.00
合计	161,969.80

7.4.7.20 分部报告

无。

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
华富基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”）	基金托管人、基金销售机构
华安证券股份有限公司（“华安证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
安徽省信用融资担保集团有限公司	基金管理人的股东
合肥兴泰金融控股（集团）有限公司	基金管理人的股东
上海华富利得资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年8月19日（基金合同生效日）至2025年 12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
华安证券	514,461,033.91	100.00

7.4.10.1.2 债券交易

注：无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年8月19日（基金合同生效日）至2025年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）

华安证券	79,000,000.00	100.00
------	---------------	--------

注：本表中“当期债券回购成交总额”为当期通过交易单元进行的交易所债券回购成交总额。

#### 7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年8月19日（基金合同生效日）至2025年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 （%）
华安证券	95,636.94	100.00	-	-

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算。以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费等费用后的净额列示。

2. 根据证监会公告[2024]3号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自2024年7月1日起，本产品交易佣金仅用于支付向证券公司租用交易单元所产生的费用。

#### 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8月19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	319,176.95
其中：应支付销售机构的客户维护费	150,395.58
应支付基金管理人的净管理费	168,781.37

注：基金管理费按前一日基金资产净值0.50%的年费率逐日计提，按月支付。计算方法  $H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金管理费，E 为前一日基金资产净值）。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年8月19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	63,835.39

注：基金托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率逐日计提，按月支付。计算方法  $H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金托管费，E 为前一日基金资产净值）。

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 8 月 19 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		
	华富中证 A500 指数 A	华富中证 A500 指数 C	合计
浦发银行	-	89,681.33	89,681.33
华安证券	-	492.37	492.37
合计	-	90,173.70	90,173.70

注：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按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。计算公式  $H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$ （H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费，E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值）。

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

注：无。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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

注：无。

7.4.10.4.2 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

注：无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金本报告期内本基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 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

注：本基金本报告期基金管理人之外的其他关联方没有投资本基金。

7.4.10.6 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 8 月 19 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
浦发银行	10,703,039.85	24,797.29

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行活期利率/银行同业利率/约定利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 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

注：无。

##### 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
688012	中微公司	2025 年 12 月 19 日	重大事项停牌	283.76	2026 年 1 月 5 日	278.00	1,821	538,287.07	516,726.96	-
002049	紫光国微	2025 年 12 月 30 日	重大事项停牌	78.81	2026 年 1 月 15 日	86.69	2,600	223,963.85	204,906.00	-

##### 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

注：本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无未到期交易所市场债券正回购。

##### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：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面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人已建立董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系，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。

董事会下设风险管理委员会，负责对公司风险管理制度进行审查并提供咨询和建议。总经理下设投资决策委员会和风险控制委员会，负责对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和监控。

公司设督察长，组织、指导公司监察稽核工作，监督检查基金及公司运作的合法合规情况和公司的内部风险控制情况。公司设有独立的风险管理部、监察稽核部，对公司各部门内部风险控制制度的建立和落实情况进行检查，对公司的内部风险控制制度的合理性、有效性进行分析，提出改进意见，上报总经理，通报督察长。

### 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在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，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。

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。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的债券。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的债券

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可银行间同业市场交易。因此除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，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，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。除卖出回购金融资产款将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所持有的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，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 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	10,703,039.85	-	-	-	-	-	10,703,039.85
结算备付金	2,673,419.24	-	-	-	-	-	2,673,419.24
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	-	98,430,367.08	98,430,367.08
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	34,966.04	34,966.04
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	13,376,459.09	-	-	-	-	98,465,333.12	111,841,792.21
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	7,269,993.30	7,269,993.30
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	48,432.87	48,432.87
应付托管费	-	-	-	-	-	9,686.55	9,686.55
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	14,600.63	14,600.63
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	2.17	2.17
其他负债	-	-	-	-	-	159,284.00	159,284.00
负债总计	-	-	-	-	-	7,501,999.52	7,501,999.52
利率敏感度缺口	13,376,459.09	-	-	-	-	-90,963,333.60	104,339,792.69

注：本表按照金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者作为期限分类标准。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本报告期末，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股票和债券，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。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

#### 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	98,430,367.08	94.34
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-
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	98,430,367.08	94.34

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 除业绩比较基准外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 12 月 31 日)
	业绩比较基准上升百分之五	5,408,255.56
	业绩比较基准下降百分之五	-5,408,255.56

### 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	97,708,734.12
第二层次	721,632.96
第三层次	-
合计	98,430,367.08

##### 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证券，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证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，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本期末未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

##### 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	98,430,367.08	88.01
	其中：股票	98,430,367.08	88.01
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	13,376,459.09	11.96
8	其他各项资产	34,966.04	0.03
9	合计	111,841,792.21	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	511,020.00	0.49
B	采矿业	5,718,716.00	5.48
C	制造业	62,197,967.54	59.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,264,127.00	2.17
E	建筑业	1,482,123.00	1.42
F	批发和零售业	576,367.00	0.55
G	交通运输、仓储和邮政业	2,761,458.00	2.65
H	住宿和餐饮业	82,307.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,592,868.50	5.36
J	金融业	11,769,853.00	11.28
K	房地产业	859,248.00	0.82
L	租赁和商务服务业	1,077,156.00	1.03
M	科学研究和技术服务业	1,101,138.00	1.06
N	水利、环境和公共设施管理业	215,854.00	0.21
O	居民服务、修理	-	-

	和其他服务业		
P	教育	47,950.00	0.05
Q	卫生和社会工作	287,502.00	0.28
R	文化、体育和娱乐业	185,882.00	0.18
S	综合	-	-
	合计	96,731,537.04	92.71

### 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	-	-
C	制造业	1,076,232.54	1.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	108,173.00	0.10
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	60,321.00	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	184,909.50	0.18
J	金融业	157,044.00	0.15
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	112,150.00	0.11
	合计	1,698,830.04	1.63

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

## 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	8,900	3,268,614.00	3.13
2	600519	贵州茅台	2,200	3,029,796.00	2.90
3	601318	中国平安	36,000	2,462,400.00	2.36
4	300308	中际旭创	3,800	2,318,000.00	2.22
5	601899	紫金矿业	55,500	1,913,085.00	1.83
6	600036	招商银行	41,800	1,759,780.00	1.69
7	300502	新易盛	3,600	1,551,168.00	1.49
8	000333	美的集团	16,400	1,281,660.00	1.23
9	601166	兴业银行	56,700	1,194,102.00	1.14
10	600900	长江电力	40,800	1,109,352.00	1.06
11	688256	寒武纪	743	1,007,173.65	0.97
12	300059	东方财富	42,600	987,468.00	0.95
13	002475	立讯精密	17,100	969,741.00	0.93
14	600030	中信证券	32,500	933,075.00	0.89
15	002594	比亚迪	9,300	908,796.00	0.87
16	600276	恒瑞医药	15,000	893,550.00	0.86
17	300274	阳光电源	5,000	855,200.00	0.82
18	601398	工商银行	107,500	852,475.00	0.82
19	688981	中芯国际	6,909	848,632.47	0.81
20	603259	药明康德	8,500	770,440.00	0.74
21	688041	海光信息	3,431	769,950.71	0.74
22	601288	农业银行	95,700	734,976.00	0.70
23	002371	北方华创	1,600	734,528.00	0.70
24	000858	五粮液	6,800	720,392.00	0.69
25	300476	胜宏科技	2,300	661,434.00	0.63
26	601328	交通银行	90,000	652,500.00	0.63
27	000651	格力电器	15,200	611,344.00	0.59
28	600887	伊利股份	21,300	609,180.00	0.58
29	603993	洛阳钼业	29,100	582,000.00	0.56
30	603986	兆易创新	2,500	535,625.00	0.51
31	000725	京东方 A	123,700	520,777.00	0.50
32	688012	中微公司	1,821	516,726.96	0.50
33	601816	京沪高铁	99,000	509,850.00	0.49
34	600150	中国船舶	15,300	508,878.00	0.49
35	600309	万华化学	6,600	506,088.00	0.49
36	300124	汇川技术	6,600	497,178.00	0.48
37	601601	中国太保	11,700	490,347.00	0.47
38	688008	澜起科技	4,095	482,391.00	0.46

39	002714	牧原股份	9,400	475,452.00	0.46
40	601088	中国神华	11,200	453,600.00	0.43
41	603019	中科曙光	5,200	445,328.00	0.43
42	300760	迈瑞医疗	2,300	438,035.00	0.42
43	600031	三一重工	20,100	424,713.00	0.41
44	002050	三花智控	7,600	420,356.00	0.40
45	000063	中兴通讯	10,800	408,672.00	0.39
46	600111	北方稀土	8,800	405,856.00	0.39
47	601857	中国石油	38,300	398,703.00	0.38
48	002230	科大讯飞	7,900	397,291.00	0.38
49	603501	豪威集团	3,100	390,290.00	0.37
50	002384	东山精密	4,600	389,390.00	0.37
51	600089	特变电工	17,300	384,406.00	0.37
52	601012	隆基绿能	20,700	376,740.00	0.36
53	000001	平安银行	32,800	374,248.00	0.36
54	002415	海康威视	12,500	373,000.00	0.36
55	601127	赛力斯	3,000	362,880.00	0.35
56	600660	福耀玻璃	5,600	362,712.00	0.35
57	603799	华友钴业	5,300	361,778.00	0.35
58	002463	沪电股份	4,900	358,043.00	0.34
59	601668	中国建筑	69,700	357,561.00	0.34
60	002028	思源电气	2,300	355,557.00	0.34
61	300394	天孚通信	1,700	345,151.00	0.33
62	600690	海尔智家	12,800	333,952.00	0.32
63	000425	徐工机械	28,800	333,504.00	0.32
64	601888	中国中免	3,500	330,960.00	0.32
65	601728	中国电信	52,400	330,120.00	0.32
66	601600	中国铝业	26,900	328,718.00	0.32
67	601919	中远海控	21,200	321,816.00	0.31
68	000100	TCL 科技	70,100	318,254.00	0.31
69	002352	顺丰控股	8,300	318,056.00	0.30
70	000338	潍柴动力	18,400	316,480.00	0.30
71	600183	生益科技	4,400	314,204.00	0.30
72	600406	国电南瑞	13,700	307,976.00	0.30
73	000792	盐湖股份	10,900	306,944.00	0.29
74	600418	江淮汽车	6,200	306,900.00	0.29
75	600028	中国石化	49,300	304,674.00	0.29
76	000568	泸州老窖	2,600	302,172.00	0.29
77	300014	亿纬锂能	4,500	295,920.00	0.28
78	300033	同花顺	900	289,962.00	0.28
79	000988	华工科技	3,600	285,588.00	0.27
80	601225	陕西煤业	13,300	283,556.00	0.27
81	601766	中国中车	41,200	280,984.00	0.27

82	601988	中国银行	48,400	277,332.00	0.27
83	600050	中国联通	52,900	270,319.00	0.26
84	601628	中国人寿	5,900	268,450.00	0.26
85	688111	金山办公	852	261,623.64	0.25
86	002625	光启技术	5,200	253,552.00	0.24
87	000977	浪潮信息	3,800	253,080.00	0.24
88	002027	分众传媒	34,300	252,791.00	0.24
89	002460	赣锋锂业	4,000	251,560.00	0.24
90	600938	中国海油	8,300	250,494.00	0.24
91	688271	联影医疗	1,980	248,490.00	0.24
92	002241	歌尔股份	8,600	247,078.00	0.24
93	601689	拓普集团	3,200	246,976.00	0.24
94	000408	藏格矿业	2,900	244,760.00	0.23
95	600547	山东黄金	6,300	243,873.00	0.23
96	601985	中国核电	27,900	241,335.00	0.23
97	600104	上汽集团	15,600	237,432.00	0.23
98	000807	云铝股份	7,200	236,448.00	0.23
99	600489	中金黄金	10,000	233,600.00	0.22
100	002709	天赐材料	4,900	227,017.00	0.22
101	300136	信维通信	3,600	223,200.00	0.21
102	601100	恒立液压	2,000	219,820.00	0.21
103	600019	宝钢股份	29,500	219,775.00	0.21
104	300408	三环集团	4,800	219,600.00	0.21
105	603288	海天味业	5,900	218,418.00	0.21
106	688072	拓荆科技	657	216,810.00	0.21
107	002558	巨人网络	5,000	216,450.00	0.21
108	300433	蓝思科技	7,000	211,890.00	0.20
109	601658	邮储银行	38,800	211,460.00	0.20
110	601006	大秦铁路	40,900	211,044.00	0.20
111	002466	天齐锂业	3,800	210,444.00	0.20
112	002916	深南电路	900	209,061.00	0.20
113	600362	江西铜业	3,800	208,696.00	0.20
114	000625	长安汽车	17,400	206,364.00	0.20
115	600905	三峡能源	50,200	205,318.00	0.20
116	002049	紫光国微	2,600	204,906.00	0.20
117	600436	片仔癀	1,200	202,536.00	0.19
118	600879	航天电子	9,400	200,408.00	0.19
119	600118	中国卫星	2,100	199,395.00	0.19
120	600438	通威股份	9,700	199,044.00	0.19
121	002738	中矿资源	2,500	196,375.00	0.19
122	300450	先导智能	3,900	194,922.00	0.19
123	601390	中国中铁	36,000	194,760.00	0.19
124	600893	航发动力	4,800	192,144.00	0.18

125	600160	巨化股份	5,000	192,100.00	0.18
126	600584	长电科技	5,200	191,256.00	0.18
127	600988	赤峰黄金	6,100	190,564.00	0.18
128	600010	包钢股份	79,800	189,924.00	0.18
129	601727	上海电气	22,000	189,420.00	0.18
130	600585	海螺水泥	8,600	187,996.00	0.18
131	000538	云南白药	3,300	187,308.00	0.18
132	605499	东鹏饮料	700	187,173.00	0.18
133	300015	爱尔眼科	16,500	181,170.00	0.17
134	600115	中国东航	30,000	180,000.00	0.17
135	600760	中航沈飞	3,200	179,680.00	0.17
136	000938	紫光股份	7,000	172,200.00	0.17
137	600487	亨通光电	6,900	170,637.00	0.16
138	600426	华鲁恒升	5,400	169,722.00	0.16
139	600346	恒力石化	7,500	168,975.00	0.16
140	002179	中航光电	4,700	166,568.00	0.16
141	002156	通富微电	4,400	165,880.00	0.16
142	601168	西部矿业	6,000	165,840.00	0.16
143	600570	恒生电子	5,500	165,825.00	0.16
144	000426	兴业银锡	4,600	163,760.00	0.16
145	002353	杰瑞股份	2,300	162,909.00	0.16
146	000630	铜陵有色	27,100	162,871.00	0.16
147	600066	宇通客车	4,900	160,230.00	0.15
148	600795	国电电力	31,400	158,256.00	0.15
149	601669	中国电建	30,300	157,560.00	0.15
150	600096	云天化	4,700	157,027.00	0.15
151	002532	天山铝业	9,700	156,946.00	0.15
152	000933	神火股份	5,700	156,579.00	0.15
153	600415	小商品城	9,800	156,310.00	0.15
154	000547	航天发展	4,700	155,147.00	0.15
155	600989	宝丰能源	7,800	153,114.00	0.15
156	002407	多氟多	4,500	152,595.00	0.15
157	002074	国轩高科	3,900	152,529.00	0.15
158	600048	保利发展	25,000	152,500.00	0.15
159	300604	长川科技	1,500	151,965.00	0.15
160	600029	南方航空	18,900	151,389.00	0.15
161	002202	金风科技	7,400	150,960.00	0.14
162	000975	山金国际	6,200	150,846.00	0.14
163	601058	赛轮轮胎	9,300	150,474.00	0.14
164	000157	中联重科	17,400	150,162.00	0.14
165	002340	格林美	17,900	149,644.00	0.14
166	300339	润和软件	3,000	148,500.00	0.14
167	688120	华海清科	980	147,078.40	0.14

168	600176	中国巨石	8,600	147,060.00	0.14
169	600143	金发科技	7,500	146,550.00	0.14
170	300058	蓝色光标	12,600	145,152.00	0.14
171	002920	德赛西威	1,200	144,360.00	0.14
172	600009	上海机场	4,400	144,144.00	0.14
173	600549	厦门钨业	3,500	143,710.00	0.14
174	002195	岩山科技	19,900	141,091.00	0.14
175	300395	菲利华	1,400	140,420.00	0.13
176	002001	新和成	5,500	138,545.00	0.13
177	601360	三六零	12,400	138,508.00	0.13
178	300223	北京君正	1,300	137,852.00	0.13
179	002517	恺英网络	6,300	137,781.00	0.13
180	300418	昆仑万维	3,300	137,610.00	0.13
181	300207	欣旺达	5,200	135,980.00	0.13
182	688122	西部超导	1,800	134,244.00	0.13
183	002131	利欧股份	23,700	133,668.00	0.13
184	002436	兴森科技	6,300	133,371.00	0.13
185	688169	石头科技	871	132,444.26	0.13
186	688608	恒玄科技	582	132,079.08	0.13
187	002008	大族激光	3,200	131,808.00	0.13
188	688126	沪硅产业	6,081	131,592.84	0.13
189	600219	南山铝业	24,400	131,272.00	0.13
190	002236	大华股份	6,900	130,686.00	0.13
191	000963	华东医药	3,300	130,185.00	0.12
192	002555	三七互娱	5,500	129,800.00	0.12
193	000768	中航西飞	5,100	129,438.00	0.12
194	688002	睿创微纳	1,281	129,124.80	0.12
195	688099	晶晨股份	1,480	129,100.40	0.12
196	600885	宏发股份	4,200	127,680.00	0.12
197	600895	张江高科	2,900	127,310.00	0.12
198	300442	润泽科技	2,400	126,720.00	0.12
199	002938	鹏鼎控股	2,500	126,450.00	0.12
200	002273	水晶光电	5,000	125,600.00	0.12
201	000831	中国稀土	2,700	125,388.00	0.12
202	002493	荣盛石化	10,700	125,297.00	0.12
203	601186	中国铁建	16,300	125,021.00	0.12
204	601111	中国国航	13,300	124,621.00	0.12
205	600196	复星医药	4,700	124,503.00	0.12
206	002456	欧菲光	11,600	123,192.00	0.12
207	600745	闻泰科技	3,300	123,024.00	0.12
208	600460	士兰微	4,200	119,322.00	0.11
209	688036	传音控股	1,800	119,088.00	0.11
210	688777	中控技术	2,413	119,057.42	0.11

211	002812	恩捷股份	2,100	118,944.00	0.11
212	002281	光迅科技	1,700	118,915.00	0.11
213	002472	双环传动	2,500	118,525.00	0.11
214	002595	豪迈科技	1,400	118,314.00	0.11
215	600839	四川长虹	13,000	118,300.00	0.11
216	002252	上海莱士	18,600	117,924.00	0.11
217	002601	龙佰集团	6,000	117,480.00	0.11
218	002422	科伦药业	4,000	117,400.00	0.11
219	300757	罗博特科	500	116,650.00	0.11
220	600699	均胜电子	3,700	116,032.00	0.11
221	600011	华能国际	15,500	115,630.00	0.11
222	600372	中航机载	8,600	115,412.00	0.11
223	300390	天华新能	2,100	114,681.00	0.11
224	002128	电投能源	4,100	114,431.00	0.11
225	600741	华域汽车	5,700	114,000.00	0.11
226	002465	海格通信	7,200	113,400.00	0.11
226	300347	泰格医药	2,000	113,400.00	0.11
227	600886	国投电力	8,500	111,520.00	0.11
228	603129	春风动力	400	111,472.00	0.11
229	001979	招商蛇口	12,900	111,456.00	0.11
230	000002	万科 A	23,900	111,135.00	0.11
231	000661	长春高新	1,200	111,060.00	0.11
232	600392	盛和资源	5,100	109,803.00	0.11
233	688396	华润微	2,070	109,420.20	0.10
234	601877	正泰电器	3,900	108,771.00	0.10
235	002648	卫星化学	6,100	107,848.00	0.10
236	600515	海南机场	20,200	107,666.00	0.10
237	601868	中国能建	45,700	107,395.00	0.10
238	300346	南大光电	2,500	107,250.00	0.10
239	603659	璞泰来	3,900	106,626.00	0.10
240	603979	金诚信	1,400	106,610.00	0.10
241	002138	顺络电子	3,000	106,590.00	0.10
242	300782	卓胜微	1,300	105,924.00	0.10
243	300054	鼎龙股份	2,800	105,280.00	0.10
244	300037	新宙邦	2,000	104,800.00	0.10
245	601633	长城汽车	4,600	104,098.00	0.10
246	002294	信立泰	2,100	104,055.00	0.10
247	002497	雅化集团	4,200	103,950.00	0.10
248	003816	中国广核	27,600	103,776.00	0.10
249	300454	深信服	900	103,644.00	0.10
250	301358	湖南裕能	1,600	103,456.00	0.10
251	600233	圆通速递	6,300	103,446.00	0.10
252	605117	德业股份	1,200	103,440.00	0.10

253	300661	圣邦股份	1,500	102,960.00	0.10
254	300866	安克创新	900	102,951.00	0.10
255	000878	云南铜业	5,000	102,550.00	0.10
256	601872	招商轮船	11,400	102,372.00	0.10
257	000301	东方盛虹	9,400	102,366.00	0.10
258	601800	中国交建	12,400	102,176.00	0.10
259	601021	春秋航空	1,700	101,150.00	0.10
260	000066	中国长城	7,000	100,870.00	0.10
261	688506	百利天恒	311	100,484.10	0.10
262	600141	兴发集团	2,900	100,282.00	0.10
263	600674	川投能源	7,200	100,080.00	0.10
264	301236	软通动力	2,100	99,603.00	0.10
265	600588	用友网络	7,500	99,450.00	0.10
266	601319	中国人保	11,100	99,345.00	0.10
267	002185	华天科技	9,000	98,730.00	0.09
268	601117	中国化学	13,100	98,643.00	0.09
269	000960	锡业股份	3,500	97,580.00	0.09
270	002130	沃尔核材	3,700	97,384.00	0.09
271	688213	思特威	1,021	97,086.89	0.09
272	601615	明阳智能	6,700	97,016.00	0.09
273	600352	浙江龙盛	9,100	97,006.00	0.09
274	002129	TCL 中环	11,300	96,841.00	0.09
275	300724	捷佳伟创	1,000	95,600.00	0.09
276	002271	东方雨虹	7,000	95,130.00	0.09
277	000786	北新建材	3,800	94,886.00	0.09
278	302132	中航成飞	1,200	94,800.00	0.09
279	002078	太阳纸业	6,000	94,500.00	0.09
280	300759	康龙化成	3,300	93,819.00	0.09
281	600498	烽火通信	2,900	93,032.00	0.09
282	600039	四川路桥	9,300	92,535.00	0.09
283	002414	高德红外	6,300	92,421.00	0.09
284	601233	桐昆股份	5,200	89,492.00	0.09
285	688047	龙芯中科	676	89,306.36	0.09
286	688578	艾力斯	855	89,048.25	0.09
287	002409	雅克科技	1,200	88,920.00	0.09
288	603087	甘李药业	1,300	88,491.00	0.08
289	300316	晶盛机电	2,400	88,200.00	0.08
290	300017	网宿科技	8,600	88,150.00	0.08
291	300496	中科创达	1,300	87,750.00	0.08
292	300073	当升科技	1,500	86,700.00	0.08
293	002085	万丰奥威	5,400	86,454.00	0.08
294	300474	景嘉微	1,200	86,244.00	0.08
295	000617	中油资本	8,900	85,440.00	0.08

296	300251	光线传媒	5,200	85,176.00	0.08
297	002444	巨星科技	2,500	85,050.00	0.08
298	300896	爱美客	600	85,032.00	0.08
299	600482	中国动力	4,100	84,870.00	0.08
300	002155	湖南黄金	4,000	84,360.00	0.08
301	300024	机器人	4,600	83,674.00	0.08
302	603606	东方电缆	1,400	83,650.00	0.08
303	300699	光威复材	2,100	82,866.00	0.08
304	300012	华测检测	6,100	82,655.00	0.08
305	002459	晶澳科技	7,200	82,440.00	0.08
306	300751	迈为股份	400	82,396.00	0.08
307	300285	国瓷材料	3,000	82,230.00	0.08
308	002624	完美世界	5,000	81,950.00	0.08
309	688223	晶科能源	14,493	81,740.52	0.08
310	000034	神州数码	2,100	81,711.00	0.08
311	300122	智飞生物	4,300	81,141.00	0.08
312	603486	科沃斯	1,000	80,680.00	0.08
313	600085	同仁堂	2,500	80,650.00	0.08
314	002223	鱼跃医疗	2,100	80,241.00	0.08
315	300002	神州泰岳	6,900	79,488.00	0.08
316	688599	天合光能	4,800	79,440.00	0.08
317	002064	华峰化学	7,200	79,200.00	0.08
318	600497	驰宏锌锗	10,800	78,948.00	0.08
319	300919	中伟新材	1,700	78,761.00	0.08
320	300832	新产业	1,400	78,750.00	0.08
321	600256	广汇能源	16,000	78,720.00	0.08
322	000423	东阿阿胶	1,600	78,528.00	0.08
323	603596	伯特利	1,500	76,905.00	0.07
324	002410	广联达	6,100	76,738.00	0.07
325	600862	中航高科	3,200	75,616.00	0.07
326	002180	纳思达	3,700	74,814.00	0.07
327	002405	四维图新	8,300	74,783.00	0.07
328	002245	蔚蓝锂芯	4,200	74,760.00	0.07
329	001965	招商公路	7,400	74,592.00	0.07
330	300003	乐普医疗	4,700	74,307.00	0.07
331	601799	星宇股份	600	74,022.00	0.07
332	688180	君实生物	2,160	73,785.60	0.07
333	000733	振华科技	1,400	73,374.00	0.07
334	601618	中国中冶	24,700	73,359.00	0.07
335	002065	东华软件	8,000	73,200.00	0.07
335	300568	星源材质	4,800	73,200.00	0.07
336	600637	东方明珠	7,400	72,890.00	0.07
337	600803	新奥股份	3,500	72,660.00	0.07

338	002318	久立特材	2,500	72,375.00	0.07
339	688235	百济神州	267	71,716.20	0.07
340	000999	华润三九	2,500	71,150.00	0.07
341	605589	圣泉集团	2,500	70,750.00	0.07
342	688005	容百科技	1,980	70,092.00	0.07
343	600026	中远海能	6,000	70,080.00	0.07
344	300627	华测导航	2,000	69,820.00	0.07
345	000887	中鼎股份	3,000	69,630.00	0.07
346	300438	鹏辉能源	1,300	69,186.00	0.07
347	603260	合盛硅业	1,300	68,510.00	0.07
348	300413	芒果超媒	2,800	68,376.00	0.07
349	000623	吉林敖东	3,500	68,355.00	0.07
350	601179	中国西电	7,500	68,250.00	0.07
351	601677	明泰铝业	4,600	68,034.00	0.07
352	000830	鲁西化工	4,100	67,937.00	0.07
353	000683	博源化工	9,100	67,704.00	0.06
354	000039	中集集团	6,700	67,603.00	0.06
355	688303	大全能源	2,520	67,586.40	0.06
356	000932	华菱钢铁	12,000	67,440.00	0.06
357	600765	中航重机	3,500	67,060.00	0.06
358	300001	特锐德	2,600	66,768.00	0.06
359	600845	宝信软件	3,200	66,272.00	0.06
360	000009	中国宝安	6,700	65,995.00	0.06
361	002756	永兴材料	1,200	65,100.00	0.06
362	002152	广电运通	4,700	64,907.00	0.06
363	601238	广汽集团	7,900	64,464.00	0.06
364	600332	白云山	2,500	64,350.00	0.06
365	000400	许继电气	2,500	64,275.00	0.06
366	300763	锦浪科技	900	64,269.00	0.06
367	000738	航发控制	3,000	63,930.00	0.06
368	300383	光环新网	5,100	63,801.00	0.06
369	603568	伟明环保	2,500	63,450.00	0.06
370	600563	法拉电子	600	62,970.00	0.06
371	603392	万泰生物	1,400	62,916.00	0.06
372	600486	扬农化工	900	62,451.00	0.06
373	600177	雅戈尔	8,200	62,320.00	0.06
374	000708	中信特钢	3,800	62,206.00	0.06
375	300142	沃森生物	5,700	62,187.00	0.06
376	600704	物产中大	11,100	61,827.00	0.06
377	603605	珀莱雅	900	61,632.00	0.06
378	300628	亿联网络	1,700	60,605.00	0.06
379	002176	江特电机	6,200	60,388.00	0.06
380	002389	航天彩虹	2,500	59,950.00	0.06

381	688266	泽璟制药	640	59,328.00	0.06
382	002007	华兰生物	3,900	59,007.00	0.06
383	600153	建发股份	6,300	58,275.00	0.06
384	000519	中兵红箭	3,200	58,272.00	0.06
385	600499	科达制造	4,200	58,254.00	0.06
386	002044	美年健康	11,000	58,080.00	0.06
387	600208	衢州发展	15,000	58,050.00	0.06
388	601216	君正集团	12,000	57,840.00	0.06
389	600521	华海药业	3,400	57,698.00	0.06
390	601567	三星医疗	2,500	57,550.00	0.06
391	600161	天坛生物	3,500	57,190.00	0.05
392	601607	上海医药	3,200	57,152.00	0.05
393	300459	汤姆猫	12,400	56,916.00	0.05
394	600516	方大炭素	10,000	56,900.00	0.05
395	002821	凯莱英	600	55,758.00	0.05
396	300253	卫宁健康	6,300	55,566.00	0.05
397	002841	视源股份	1,400	55,482.00	0.05
398	300567	精测电子	600	54,720.00	0.05
399	002603	以岭药业	3,200	54,624.00	0.05
400	600018	上港集团	9,900	53,658.00	0.05
401	002739	万达电影	4,700	53,204.00	0.05
402	603806	福斯特	3,800	53,048.00	0.05
403	300068	南都电源	3,400	52,836.00	0.05
404	300088	长信科技	8,700	52,722.00	0.05
405	600316	洪都航空	1,500	52,365.00	0.05
406	603816	顾家家居	1,700	52,258.00	0.05
407	002432	九安医疗	1,300	52,052.00	0.05
408	600312	平高电气	3,000	52,050.00	0.05
409	600398	海澜之家	8,600	52,030.00	0.05
410	000629	钒钛股份	16,400	50,840.00	0.05
411	600820	隧道股份	7,800	50,622.00	0.05
412	600038	中直股份	1,400	50,582.00	0.05
413	688009	中国通号	9,237	50,526.39	0.05
414	601018	宁波港	13,800	50,094.00	0.05
415	300118	东方日升	3,400	49,844.00	0.05
416	600166	福田汽车	16,900	49,348.00	0.05
417	600170	上海建工	18,600	49,290.00	0.05
418	603885	吉祥航空	3,300	49,104.00	0.05
419	603077	和邦生物	21,600	48,816.00	0.05
420	688617	惠泰医疗	200	48,654.00	0.05
421	600323	瀚蓝环境	1,700	48,620.00	0.05
422	002544	普天科技	1,400	48,286.00	0.05
423	600763	通策医疗	1,200	48,252.00	0.05

424	002607	中公教育	17,500	47,950.00	0.05
425	600529	山东药玻	2,400	47,832.00	0.05
426	300144	宋城演艺	5,800	47,502.00	0.05
427	601155	新城控股	3,400	47,430.00	0.05
428	002244	滨江集团	4,700	47,235.00	0.05
429	600859	王府井	3,000	46,590.00	0.04
430	002145	钛能化学	9,500	46,550.00	0.04
431	600008	首创环保	15,400	46,200.00	0.04
432	603939	益丰药房	2,100	45,612.00	0.04
433	600998	九州通	8,900	45,568.00	0.04
434	002025	航天电器	900	45,117.00	0.04
435	002312	川发龙蟒	4,100	44,813.00	0.04
436	603650	彤程新材	1,000	44,140.00	0.04
437	600535	天士力	2,900	43,703.00	0.04
438	600004	白云机场	4,500	42,570.00	0.04
439	601880	辽港股份	26,600	42,560.00	0.04
440	600667	太极实业	5,300	42,241.00	0.04
441	300573	兴齐眼药	600	42,174.00	0.04
442	300558	贝达药业	900	42,021.00	0.04
443	600258	首旅酒店	2,500	41,875.00	0.04
444	601000	唐山港	10,700	41,088.00	0.04
445	300676	华大基因	900	40,824.00	0.04
446	600754	锦江酒店	1,600	40,432.00	0.04
447	300457	赢合科技	1,400	38,990.00	0.04
448	000818	航锦科技	2,000	38,600.00	0.04
449	002266	浙富控股	9,200	38,272.00	0.04
450	600511	国药股份	1,300	37,375.00	0.04
451	600655	豫园股份	7,200	36,936.00	0.04
452	300601	康泰生物	2,500	36,925.00	0.04
453	601966	玲珑轮胎	2,500	36,325.00	0.03
454	000998	隆平高科	3,800	35,568.00	0.03
455	000035	中国天楹	6,400	35,328.00	0.03
456	000967	盈峰环境	4,800	35,232.00	0.03
457	000069	华侨城 A	14,200	35,216.00	0.03
458	603899	晨光股份	1,300	35,178.00	0.03
459	600867	通化东宝	4,300	35,131.00	0.03
460	002120	韵达股份	5,200	35,048.00	0.03
461	688390	固德威	560	34,792.80	0.03
462	601866	中远海发	13,800	34,776.00	0.03
463	688188	柏楚电子	250	33,972.50	0.03
464	300529	健帆生物	1,700	33,439.00	0.03
465	002091	江苏国泰	3,700	33,411.00	0.03
466	600325	华发股份	7,900	33,338.00	0.03

467	688063	派能科技	560	31,819.20	0.03
468	603833	欧派家居	600	31,254.00	0.03
469	000032	深桑达 A	1,600	30,960.00	0.03
470	600864	哈投股份	4,600	30,498.00	0.03
471	300070	碧水源	7,700	30,184.00	0.03
472	002292	奥飞娱乐	3,300	29,205.00	0.03
473	002572	索菲亚	2,100	28,581.00	0.03
474	001914	招商积余	1,500	16,020.00	0.02
475	600007	中国国贸	600	11,892.00	0.01

### 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	002837	英维克	1,900	203,091.00	0.19
2	688521	芯原股份	1,350	184,909.50	0.18
3	600580	卧龙电驱	3,600	176,760.00	0.17
4	600522	中天科技	8,700	157,644.00	0.15
5	300803	指南针	1,200	157,044.00	0.15
6	002851	麦格米特	1,500	135,105.00	0.13
7	600673	东阳光	5,000	112,150.00	0.11
8	600157	永泰能源	68,900	108,173.00	0.10
9	688017	绿的谐波	450	86,445.00	0.08
10	300748	金力永磁	2,300	78,453.00	0.08
11	688472	阿特斯	4,914	73,267.74	0.07
12	688065	凯赛生物	1,260	62,748.00	0.06
13	300972	万辰集团	300	60,321.00	0.06
14	688166	博瑞医药	1,080	52,984.80	0.05
15	300083	创世纪	5,400	49,734.00	0.05

### 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	300750	宁德时代	10,916,428.60	10.46
2	600519	贵州茅台	9,096,058.00	8.72
3	601318	中国平安	7,115,042.00	6.82
4	600036	招商银行	6,027,991.00	5.78
5	300308	中际旭创	5,633,892.00	5.40
6	000333	美的集团	5,464,980.00	5.24
7	300059	东方财富	5,041,534.56	4.83
8	601899	紫金矿业	4,894,754.00	4.69
9	300502	新易盛	4,780,408.00	4.58

10	002594	比亚迪	4,696,513.01	4.50
11	002475	立讯精密	4,582,441.00	4.39
12	601166	兴业银行	3,863,250.00	3.70
13	600900	长江电力	3,820,290.00	3.66
14	688981	中芯国际	3,585,503.72	3.44
15	600276	恒瑞医药	3,303,596.00	3.17
16	600030	中信证券	3,268,805.00	3.13
17	688256	寒武纪	3,181,371.25	3.05
18	603259	药明康德	3,111,392.00	2.98
19	601398	工商银行	3,046,656.00	2.92
20	688041	海光信息	2,978,244.62	2.85
21	601288	农业银行	2,497,009.00	2.39
22	300274	阳光电源	2,356,114.00	2.26
23	000858	五粮液	2,352,239.00	2.25
24	601328	交通银行	2,089,713.00	2.00

注：本表列示“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。

#### 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	300750	宁德时代	8,353,716.00	8.01
2	600519	贵州茅台	5,871,644.00	5.63
3	601318	中国平安	5,094,357.00	4.88
4	300308	中际旭创	4,451,288.00	4.27
5	600036	招商银行	4,230,201.00	4.05
6	000333	美的集团	4,228,522.00	4.05
7	300502	新易盛	3,810,292.00	3.65
8	300059	东方财富	3,797,254.00	3.64
9	601899	紫金矿业	3,761,990.00	3.61
10	002475	立讯精密	3,717,551.00	3.56
11	002594	比亚迪	3,696,095.00	3.54
12	688981	中芯国际	2,819,106.69	2.70
13	600900	长江电力	2,709,993.00	2.60
14	601166	兴业银行	2,584,801.00	2.48
15	601398	工商银行	2,313,843.00	2.22
16	688041	海光信息	2,293,802.77	2.20
17	688256	寒武纪	2,274,754.83	2.18
18	600030	中信证券	2,265,373.00	2.17
19	603259	药明康德	2,239,628.56	2.15
20	600276	恒瑞医药	2,196,333.00	2.10

注：本表列示“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易

费用。

#### 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	303,252,479.55
卖出股票收入（成交）总额	211,208,554.36

注：本表列示“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。买入包括新股、配股、债转股及行权等获得的股票。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

#### 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

注：无。

#### 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

注：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

注：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

注：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

无。

##### 8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

#### 8.12 投资组合报告附注

##### 8.12.1 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中，招商银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、紫金矿业集团股份有限公司曾出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本报告期内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。

### 8.12.2 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

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 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	34,966.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	34,966.04

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

### 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

注：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

注：无。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 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 (%)
华富中证	626	99,306.80	0.00	0.00	62,166,056.14	100.00

A500 指数 A						
华富中证 A500 指数 C	727	54,345.87	0.00	0.00	39,509,447.51	100.00
合计	1,353	75,148.19	0.00	0.00	101,675,503.65	100.00

注：本表列示“占总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例，对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	华富中证 A500 指数 A	0.00	0.0000
	华富中证 A500 指数 C	10,001.07	0.0253
	合计	10,001.07	0.0098

注：本表列示“占总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例，对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

### 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	华富中证 A500 指数 A	0
	华富中证 A500 指数 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华富中证 A500 指数 A	0
	华富中证 A500 指数 C	0
	合计	0

注：本期末本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金基金经理未持有本开放式基金。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华富中证 A500 指数 A	华富中证 A500 指数 C
基金合同生效日 (2025 年 8 月 19)	167,083,180.90	96,235,418.16

日) 基金份额总额		
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	4,744,376.02	4,713,686.28
减: 基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	109,661,500.78	61,439,656.93
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	62,166,056.14	39,509,447.51

注: 总申购份额含红利再投、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

本报告期内未召开持有人大会。

### 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

本报告期内, 基金管理人重大人事变动情况如下:

2025 年 3 月 13 日, 经公司董事会审议批准, 免去王瑞华女士公司副总经理职务。

2025 年 4 月 29 日, 经公司董事会审议批准, 聘任余海春先生担任公司董事长, 免去赵万利先生公司董事长职务。

2025 年 12 月 23 日, 经公司董事会审议批准, 聘任李宏升先生担任公司副总经理、财务负责人, 免去北京分公司负责人、广州分公司负责人职务。

2025 年 12 月 23 日, 经公司董事会审议批准, 聘任邓朋先生担任公司副总经理、北京分公司负责人、广州分公司负责人。

2025 年 12 月 23 日, 经公司董事会审议批准, 免去陈启明先生公司副总经理职务。

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。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内没有发生诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未有改聘为其审计的会计师事务所情况。本基金本年度需支付给审计机构容诚会计师事务所（特殊普通合伙）审计报酬为 18,900.00 元人民币。容诚会计师事务所（特殊普通合伙）从 2025 年起为本公司提供审计服务。

### 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

注：本报告期内，管理人不存在受调查或处罚等情况。

#### 11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，管理人相关从业人员不存在受调查或处罚等情况。

#### 11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，托管人不存在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

注：本报告期内，托管人相关从业人员不存在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 (%)	
华安证券	2	514,461,033.91	100.00	95,636.94	100.00	-

注：1) 根据中国证监会《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（以下简称“规定”）（证监会公告[2024]3号），我公司在综合比较多家证券经营机构的财务状况、经营状况后，选择了财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易服务能力较强的券商租用了基金专用交易单元进行证券投资或委托证券公司办理证券投资。

2) 我公司自 2024 年 7 月 1 日起执行法规关于佣金比例的规定，本产品本报告期内佣金比例符合法规有关要求。

3) 此处的佣金指基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

4) 本基金使用券商结算模式，本报告期内管理人选择以上券商作为证券经纪商，使用其交易单元作为本基金的交易单元。

## 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	
	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(%)
华安证券	-	-	79,000,000.00	100.00	-	-

## 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	华富中证 A500 指数型证券投资基金基金合同	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 7 月 4 日
2	华富中证 A500 指数型证券投资基金基金份额发售公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 7 月 4 日
3	华富中证 A500 指数型证券投资基金招募说明书	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 7 月 4 日
4	华富中证 A500 指数型证券投资基金托管协议	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 7 月 4 日
5	华富中证 A500 指数型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 7 月 4 日
6	华富中证 A500 指数型证券投资基金(A 类基金份额)基金产品资料概要	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 7 月 4 日
7	华富中证 A500 指数型证券投资基金(C 类基金份额)基金产品资料概要	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 7 月 4 日
8	关于华富中证 A500 指数型证券投资基金提前结束募集的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 8 月 15 日
9	华富中证 A500 指数型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 8 月 20 日
10	华富中证 A500 指数型证券投资基金(A 类基金份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 8 月 21 日
11	华富中证 A500 指数型证券投资基金	中国证监会基金电子披	2025 年 8 月 21 日

	(C类基金份额)基金产品资料概要更新	露网站及基金管理人网站	
12	华富基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年9月5日
13	华富中证 A500 指数型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定投业务的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年9月17日
14	华富基金管理有限公司关于调整旗下部分基金风险等级的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年11月6日
15	华富中证 A500 指数型证券投资基金(A类基金份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年11月26日
16	华富中证 A500 指数型证券投资基金招募说明书更新	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年11月26日
17	华富中证 A500 指数型证券投资基金(C类基金份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年11月26日
18	华富基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年12月24日
19	华富基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年12月25日
20	华富基金管理有限公司关于董事变更情况的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年12月25日

## § 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
无							

注：本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

## 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、华富中证 A500 指数型证券投资基金基金合同
- 2、华富中证 A500 指数型证券投资基金托管协议
- 3、华富中证 A500 指数型证券投资基金招募说明书
- 4、报告期内华富中证 A500 指数型证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

### 13.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅,相关公开披露信息也可以登录基金管理人网站查阅。

华富基金管理有限公司

2026 年 3 月 31 日