

海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
2026 年中期报告
2026 年 6 月 30 日

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年八月三十一日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

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约定，于 2026 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	53
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	55
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	55
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	55
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.12 投资组合报告附注	56

§8 基金份额持有人信息	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	58
§9 开放式基金份额变动	58
§10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
10.4 基金投资策略的改变	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	59
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	59
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	59
10.8 其他重大事件	60
§11 影响投资者决策的其他重要信息	61
§12 备查文件目录	62
12.1 备查文件目录	62
12.2 存放地点	63
12.3 查阅方式	63

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	海富通中证 A500ETF
场内简称	中证 A500ETF 海富通
基金主代码	563860
交易代码	563860
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 1 月 22 日
基金管理人	海富通基金管理有限公司
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	158,844,300.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2025 年 2 月 12 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用被动指数化投资策略，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要投资策略包括股票投资策略，债券投资策略，可转换债券和可交换债券投资策略，资产支持证券投资策略，股指期货投资策略，国债期货投资策略，股票期权投资策略，融资及转融通证券出借策略，存托凭证投资策略等
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率
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。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

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		海富通基金管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	岳冲	汪小敏
	联系电话	021-38650788	021-31888888
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	wangxm8@spdb.com.cn
客户服务电话		40088-40099	95528
传真		021-33830166	021-63602540

注册地址	中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路479号18层 1802-1803室以及19层 1901-1908室	上海市中山东一路12号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路479号18层 1802-1803室以及19层 1901-1908室	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	谢乐斌	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	《中国证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.hftfund.com
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	66,073,136.50
本期利润	40,126,088.35
加权平均基金份额本期利润	0.1846
本期加权平均净值利润率	14.02%
本期基金份额净值增长率	13.89%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	67,321,527.99
期末可供分配基金份额利润	0.4238
期末基金资产净值	226,165,827.99
期末基金份额净值	1.4238
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	42.38%

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、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、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)。

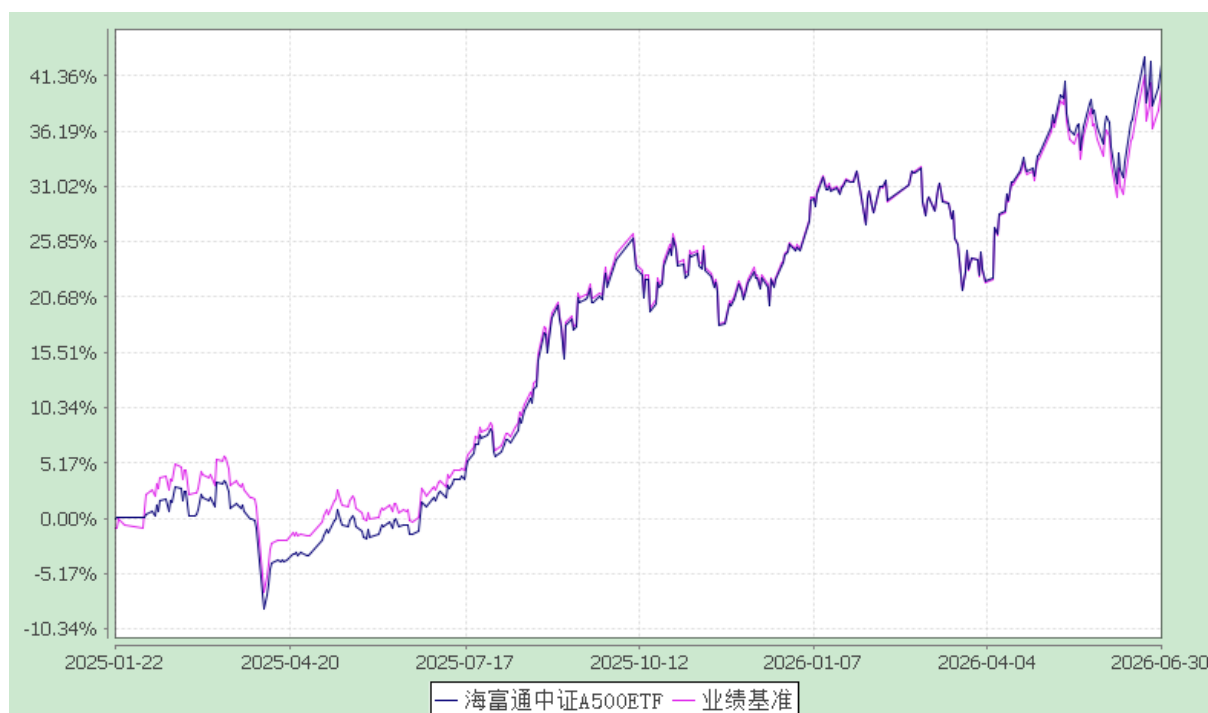
3.2 基金净值表现

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

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	16.00%	1.40%	14.26%	1.41%	1.74%	-0.01%
过去六个月	13.89%	1.28%	11.91%	1.29%	1.98%	-0.01%
过去一年	39.96%	1.13%	36.38%	1.14%	3.58%	-0.01%
自基金合同生效起至今	42.38%	1.10%	40.11%	1.12%	2.27%	-0.02%

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

海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2025 年 1 月 22 日至 2026 年 6 月 30 日)



注：本基金合同于 2025 年 1 月 22 日生效，按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

§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

基金管理人海富通基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2003]48 号文批准，于 2003 年 4 月 1 日发起设立。目前，公司的股东为国泰海通证券股份有限公司、法国巴黎资产管理 BE 控股公司，注册资本为 3 亿元人民币。

截至 2026 年 6 月 30 日，本基金管理人旗下运作的公募基金共有 100 只，分别是：海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通股票混合型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通风格优势混合型证券投资基金、海富通精选贰号混合型证券投资基金、海富通中国海外精选混合型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通领先成长混合型证券投资基金、海富通中证 A100 指数证券投资基金(LOF)、海富通中小盘混合型证券投资基金、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通国策导向混合型证券投资基金、海富通中证 500 指数增强型证券投资基金、海富通安颐收益混合型证券投资基金、海富通一年定期开放债券型证券投资基金、海富通内需热点混合型证券投资基金、海富通纯债债券

型证券投资基金、上证城投债交易型开放式指数证券投资基金、海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金、海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金、海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞丰债券型证券投资基金、海富通聚利纯债债券型证券投资基金、海富通集利纯债债券型证券投资基金、海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）、海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞利纯债债券型证券投资基金、海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞合纯债债券型证券投资基金、海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金、海富通瑞福债券型证券投资基金、海富通瑞祥一年定期开放债券型证券投资基金、海富通添益货币市场基金、海富通聚优精选混合型基金中基金（FOF）、海富通量化先锋股票型证券投资基金、海富通融丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金、海富通恒丰定期开放债券型发起式证券投资基金、上证 10 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通弘丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通鼎丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通电子信息传媒产业股票型证券投资基金、海富通上海清算所中高等级短期融资券指数证券投资基金、海富通研究精选混合型证券投资基金、海富通稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通中短债债券型证券投资基金、海富通聚合纯债债券型证券投资基金、海富通上证 5 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通先进制造股票型证券投资基金、海富通裕通 30 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金、海富通平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通科技创新混合型证券投资基金、海富通裕昇三年定期开放债券型证券投资基金、海富通瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通富盈混合型证券投资基金、海富通富泽混合型证券投资基金、海富通上证投资级可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金、海富通成长甄选混合型证券投资基金、海富通消费核心资产混合型证券投资基金、海富通成长价值混合型证券投资基金、海富通均衡甄选混合型证券投资基金、海富通欣睿混合型证券投资基金、海富通消费优选混合型证券投资基金、海富通中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、海富通策略收益债券型证券投资基金、海富通中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、海富通利率债债券型证券投资基金、海富通瑞兴 3 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通欣利混合型证券投资基金、海富通碳中和主题混合型证券投资基金、海富通成长领航混合型证券投资基金、海富通养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通恒益金融债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通盈丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通添利收益一年持有期债券型证券投资基金、海富通悦享一年持有期混合型证券投资基金、海富通产业优选混合型证券投资

基金、海富通中债 0-2 年政策性金融债指数证券投资基金、海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、海富通红利优选混合型证券投资基金、海富通中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、海富通量化选股混合型证券投资基金、海富通上证基准做市公司债券交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金、海富通远见回报混合型证券投资基金、海富通配置优选三个月持有期混合型基金中基金(FOF)、海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金、海富通中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、海富通致远量化选股股票型发起式证券投资基金、海富通添合收益债券型证券投资基金、海富通聚益优选三个月持有期债券型基金中基金 (FOF)、海富通瑞颐 30 天滚动持有债券型证券投资基金、海富通瑞泽 90 天持有期债券型发起式证券投资基金、海富通沪港深医疗创新混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
成钧	本基金的基金 经理	2025-10-2 2	-	14 年	上海交通大学博士, 南京大学和上海上海证券交易所博士后, 持有基金从业人员资格证书。曾任职于国泰基金管理有限公司、嘉实基金管理有限公司、中国平安人寿保险股份有限公司、平安基金管理有限公司。2024 年 1 月加入海富通基金管理有限公司, 曾任指数产品专家, 2025 年 10 月起任海富通中证港股通科技 ETF、海富通中证 A500ETF 基金经理。
纪君凯	本基金的基金 经理	2025-01-2 2	2026-03-09	9 年	硕士, 持有基金从业人员资格证书。历任天风证券上海自营分公司衍生品部投资研究、期权交易职位。2017 年 7 月加入海富通基金管理有限公司, 历任投资经理、基金经理助理。2020 年 6 月至 2023 年 7 月任海富通上证非周期 ETF、海富通上证周期 ETF 基金经理。2020 年 7 月至 2022 年 12 月兼任海富通量化先锋股票、海富通中证 500 增强基金经理。2023 年 8 月至 2026 年 3 月兼任海富通中证 A100 指数 (LOF)、海富通中证港股通科技 ETF 基金经理。2024 年 4 月至 2025 年 7 月兼任海富通中证汽

					车零部件主题 ETF 基金经理。2024 年 6 月至 2026 年 3 月兼任海富通中证港股通科技 ETF 发起联接基金经理。2025 年 1 月至 2026 年 3 月兼任海富通中证 A500ETF 基金经理。
王宁宁	本基金的基金经理	2026-03-11	-	9 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。曾任平安道远投资管理(上海)有限公司企划财务部企划财务，平安基金管理有限公司 ETF 指数投资部指数研究员、ETF 基金经理助理，大成基金管理有限公司指数与期货投资部 ETF 基金经理助理。2024 年 5 月加入海富通基金管理有限公司，历任指数研究员、基金经理助理。2026 年 2 月起任海富通中证 A100 指数 (LOF)、海富通中证港股通科技 ETF 发起联接基金经理。2026 年 3 月起兼任海富通中证 A500ETF、海富通中证港股通科技 ETF 基金经理。
王宁宁	本基金的基金经理助理	2025-05-08	2026-02-09	9 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。曾任平安道远投资管理(上海)有限公司企划财务部企划财务，平安基金管理有限公司 ETF 指数投资部指数研究员、ETF 基金经理助理，大成基金管理有限公司指数与期货投资部 ETF 基金经理助理。2024 年 5 月加入海富通基金管理有限公司，历任指数研究员、基金经理助理。2026 年 2 月起任海富通中证 A100 指数 (LOF)、海富通中证港股通科技 ETF 发起联接基金经理。2026 年 3 月起兼任海富通中证 A500ETF、海富通中证港股通科技 ETF 基金经理。

注：1、对基金的首任基金经理，其任职日期指基金合同生效日，离任日期指公司做出决定之日；

非首任基金经理，其任职日期和离任日期均指公司做出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准：自参加证券行业的相关工作开始计算。

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》及其他有关法律法规、

基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金资产，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，保证公平交易制度的执行和实现。

报告期内，公司对旗下所有投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行了分析，并采集了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）公司管理的不同投资组合向交易的样本，对其进行了 95%置信区间，假设溢价率为 0 的 T 分布检验，结合该时间窗下组合互相之间的模拟输送金额、贡献度、交易占优比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明，报告期内公司对旗下各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本基金与公司管理的其他投资组合之间未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

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

经济方面，上半年经济总体平稳，结构上向新向优发展。从总量看，上半年国内 GDP 为 69.6 万亿元，实际 GDP 增速为 4.7%，符合全年增长目标。节奏上，2026 年一季度经济实现开门红，尽管二季度增速有所回落，但是经济稳定运行的基本面并没有变化。结构上，高端制造业和出口为经济增长的亮点。今年上半年以高端制造、数智经济、现代服务为代表的新动能对上半年经济增长的贡献率超过四成，经济向新向优的特点鲜明。今年上半年我国出口金额同比增长 17.60%，远高于去年同期的 5.85%。产业政策方面，国内因地制宜发展新质生产力，科技实力和经济实力持续增强。

从 A 股市场运行来看，上半年上证指数涨幅为 3.16%，沪深 300 为 7.55%，中证 500 为 20.97%，创业板指为 35.58%，科创 50 为 64.25%，中证 A500 为 11.91%。行业板块方面，根据申万一级行业分类，表现靠前的板块是电子、通信、建筑材料、机械设备，表现靠后的板块是商贸零售、农林牧渔、美容护理、食品饮料。从行情节奏看，在年初美联储宽松预期和美国财政脉冲背景下，市场交

易流动性宽松和经济复苏受益品种。但是，2 月底美伊战争爆发，油价持续高位震荡运行，美联储宽松预期消退，加息预期升温，此外战争影响了各国年内经济增长预期，此前的交易逻辑逆转。与此同时，美国科技巨头上修 2026 年资本开支，AI 投资拉动全球经济，AI 产业链成为市场的主线行情。整体而言，上半年 A 股以科技成长风格为主，AI 相关行业涨幅居前，市场结构较为分化。

作为指数基金，在操作上我们严格遵守基金合同，应用指数复制策略和数量化手段提高组合与指数的拟合度，降低跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为 13.89%，同期业绩比较基准收益率为 11.91%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从全球经济看，AI 投资拉动经济的趋势仍延续，但地缘风险仍可能扰动市场。美国对 AI 投资延续高增长，进而拉动了中国、韩国、日本等国家的出口增速。同时，也要注意今年地缘政治风险较多，海外金融市场可能面临更多波动风险，未来需要密切跟踪。

从国内市场看，市场有望震荡上行。从基本面看，国内经济向新向优，AI 产业链保持高景气度，宏观经济步入补库周期。从流动性看，国内宏观流动性保持宽松，海外宏观流动性短期趋紧但未来有望缓解，此外监管层引导中长线资金入市，整体流动性环境保持稳态。

作为指数基金，我们将继续秉承指数化投资策略，紧密跟踪指数，降低跟踪误差。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、基金合同以及中国基金业协会提供的相关估值指引对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由基金管理人与基金托管人分别独立完成。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将各类基金份额的份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

本基金管理人设立估值委员会，组成人员包括分管基金运营业务的高级管理人员、分管投资业务的高级管理人员、督察稽核部负责人、风险管理部负责人、研究部负责人及基金运营部负责人等，以上人员具有丰富的合规、风控、证券研究、会计方面的专业经验。估值委员会负责制定、更新本基金管理人管理的基金的估值政策和程序。估值委员会对经济环境发生重大变化或发生影响证券价格的重大事件进行评估，充分听取相关部门的建议，并和托管人充分协商后，提交估值建议报告，以便估值委员会决策。基金运营部按照批准后的估值政策进行估值。

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，基金管理人可每月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，收益评价日核定的基金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，基金管理人可进行收益分配。

本基金本报告期内未进行利润分配，但符合基金合同规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

§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”）在对海富通中证 A500 交易型开放式指数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，对海富通中证 A500 交易型开放式指数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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由海富通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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	1,666,783.76	5,696,042.05
结算备付金		435,225.79	822,111.98
存出保证金		59,930.02	92,012.70
交易性金融资产	6.4.7.2	225,003,897.85	402,967,400.96
其中：股票投资		225,003,897.85	402,967,400.96
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	1,815,718.66
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	60,492.63	-
资产总计		227,226,330.05	411,393,286.35
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	1,203,862.55
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		28,406.79	60,310.24
应付托管费		9,468.93	20,103.40
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	12.82
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	1,022,626.34	5,247,299.43
负债合计		1,060,502.06	6,531,588.44
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	158,844,300.00	323,844,300.00

未分配利润	6.4.7.8	67,321,527.99	81,017,397.91
净资产合计		226,165,827.99	404,861,697.91
负债和净资产总计		227,226,330.05	411,393,286.35

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.4238 元，基金份额总额 158,844,300.00 份。

6.2 利润表

会计主体：海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 22 日（基 金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		40,559,034.69	19,625,174.31
1.利息收入		6,493.46	1,481,966.35
其中：存款利息收入	6.4.7.9	6,345.62	821,501.49
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		147.84	660,464.86
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		66,033,282.00	11,189,738.30
其中：股票投资收益	6.4.7.10	64,068,204.27	1,082,864.17
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	155.47
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.12	-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	1,965,077.73	10,106,718.66
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-25,947,048.15	4,018,239.09
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	466,307.38	2,935,230.57
减：二、营业总支出		432,946.34	1,187,635.19
1. 管理人报酬		213,921.20	767,303.39
2. 托管费		71,307.13	255,767.76
3. 销售服务费		-	-
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		0.53	2,377.67
8. 其他费用	6.4.7.17	147,717.48	162,186.37
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		40,126,088.35	18,437,539.12
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		40,126,088.35	18,437,539.12
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		40,126,088.35	18,437,539.12

6.3 净资产变动表

会计主体：海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	323,844,300.00	-	81,017,397.91	404,861,697.91
二、本期期初净资产	323,844,300.00	-	81,017,397.91	404,861,697.91
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-165,000,000.00	-	-13,695,869.92	-178,695,869.92
（一）、综合收益总额	-	-	40,126,088.35	40,126,088.35
（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）	-165,000,000.00	-	-53,821,958.27	-218,821,958.27
其中：1.基金申购款	78,000,000.00	-	25,274,445.54	103,274,445.54
2.基金赎回款	-243,000,000.00	-	-79,096,403.81	-322,096,403.81
（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	158,844,300.00	-	67,321,527.99	226,165,827.99
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 22 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益（若有）	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	1,937,844,300.00	-	-	1,937,844,300.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,029,000,000.00	-	15,700,584.32	-1,013,299,415.68
（一）、综合收益总额	-	-	18,437,539.12	18,437,539.12
（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）	-1,029,000,000.00	-	-2,736,954.80	-1,031,736,954.80
其中：1.基金申购款	507,000,000.00	-	4,933,103.17	511,933,103.17
2.基金赎回款	-1,536,000,000.00	-	-7,670,057.97	-1,543,670,057.97
（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	908,844,300.00	-	15,700,584.32	924,544,884.32

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：任志强，主管会计工作负责人：胡光涛，会计机构负责人：胡正万

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金（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[2024]1757 号《关于准予海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册，由海富通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金

金法》和《海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为交易型开放式证券投资基金，存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,937,817,000.00 元。经向中国证监会备案，《海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2025 年 1 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,937,844,300.00 份，其中认购资金利息折合基金份额 27,300.00 份。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为标的指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含主板、创业板及其他经中国证监会允许发行的股票）、存托凭证、债券（国债、央行票据、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、衍生工具（股指期货、股票期权、国债期货）、货币市场工具以及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及转融通证券出借业务。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、股票期权和国债期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准：中证 A500 指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人海富通基金管理有限公司于 2026 年 8 月 28 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）发布的《公开募集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》、《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2026 年上半年度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 2026

年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年上半年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[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[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、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》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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》、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]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》、财税[2017]2 号文《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》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，截至 2027 年 12 月 31 日，免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。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，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（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。本基金管理人

运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b)对本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。

对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c)对本基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）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。对本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。

对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

d)本基金卖出股票按 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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

e)对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

6.4.7重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	1,666,783.76
等于：本金	1,666,659.85
加：应计利息	123.91
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	1,666,783.76

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		184,777,378.22	-	225,003,897.85	40,226,519.63
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		184,777,378.22	-	225,003,897.85	40,226,519.63

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	60,492.63

合计	60,492.63
----	-----------

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	24,612.64
其中：交易所市场	24,612.64
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	86,780.45
应付替代款	911,233.25
合计	1,022,626.34

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	323,844,300.00	323,844,300.00
本期申购	78,000,000.00	78,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-243,000,000.00	-243,000,000.00
本期末	158,844,300.00	158,844,300.00

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	55,323,764.52	25,693,633.39	81,017,397.91
本期期初	55,323,764.52	25,693,633.39	81,017,397.91
本期利润	66,073,136.50	-25,947,048.15	40,126,088.35
本期基金份额交易产生的变动数	-46,933,951.84	-6,888,006.43	-53,821,958.27
其中：基金申购款	27,219,505.50	-1,945,059.96	25,274,445.54
基金赎回款	-74,153,457.34	-4,942,946.47	-79,096,403.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	74,462,949.18	-7,141,421.19	67,321,527.99

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	4,398.35
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	1,828.65
其他	118.62
合计	6,345.62

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	44,323,136.20
股票投资收益——赎回差价收入	19,745,068.07
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	64,068,204.27

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	196,915,792.64
减：卖出股票成本总额	152,421,245.40
减：交易费用	171,411.04
买卖股票差价收入	44,323,136.20

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	322,096,403.81
减：现金支付赎回款总额	156,248,724.57
减：赎回股票成本总额	146,102,611.17
减：交易费用	-
赎回差价收入	19,745,068.07

6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无申购差价收入。

6.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无证券出借差价收入。

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.12 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,965,077.73
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	1,965,077.73

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	-25,947,048.15
——股票投资	-25,947,048.15
——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	-25,947,048.15

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
----	----------------------------

基金赎回费收入	-
替代损益	466,307.38
合计	466,307.38

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代方式申购（赎回）本基金时，补入（卖出）被替代证券的实际买入成本（实际卖出金额）与申购（赎回）确认日估值的差额，或强制退款的被替代证券在强制退款计算日与申购（赎回）确认日估值的差额。

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	17,356.09
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
IOPV 计算费	9,916.99
银行划款手续费	1,429.66
中登服务费	59,507.37
合计	147,717.48

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
海富通基金管理有限公司(“海富通”)	基金管理人、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
国泰海通证券股份有限公司(“国泰海通证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。关联方国泰海通证券股份有限公司（简称“国泰海通证券”）是由原国泰君安证券股份有限公司与原关联方海通证券股份有限公司于

2025 年 3 月 14 日合并组建而成。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月22日（基金合同生效日） 至2025年6月30日	
	成交金额	占当期股 票成交总 额的比例	成交金额	占当期股 票成交总 额的比例
国泰海通证券	56,542,180.70	19.38%	88,050,356.21	2.87%
海通证券	-	-	2,076,840,440.59	67.68%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 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
国泰海通证券	10,511.96	19.38%	7,660.42	31.12%
关联方名称	上年度可比期间 2025年1月22日（基金合同生效日）至2025年6月30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
海通证券	386,091.10	67.68%	-	-
国泰海通证券	16,369.10	2.87%	16,369.10	31.31%

注：1.上述佣金按协议约定的佣金率计算，佣金率由协议签订方参考市场价格确定。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金管理人提供的证券投资研究服务等。

2.根据《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，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣

金支付研究服务之外的其他费用。公司的该类佣金协议符合《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025年1月22日（基金合同 生效日）至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	213,921.20	767,303.39
其中：应支付销售机构的客户维护费	10,597.65	17,364.37
应支付基金管理人的净管理费	203,323.55	749,939.02

注：支付基金管理人海富通的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，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 x0.15%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025年1月22日（基金合同 生效日）至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	71,307.13	255,767.76

注：支付基金托管人浦发银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值 x0.05%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月22日（基金合同生效日）至 2025年6月30日
基金合同生效日 （2025年1月22日） 持有的基金份额	-	10,000,000.00
期初持有的基金份额	10,000,000.00	-
期间申购/买入总份 额	-	-
期间因拆分变动份 额	-	-
减：期间赎回/卖出总 份额	-	-
期末持有的基金份 额	10,000,000.00	10,000,000.00
期末持有的基金份 额 占基金总份额比例	6.30%	1.10%

注：基金管理人投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金 份额占基金 总份额的比 例	持有的基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例
国泰海通证券	6,029,300.00	3.7957%	8,431,938.00	2.6037%
合计	6,029,300.00	3.7957%	8,431,938.00	2.6037%

注：上述关联方投资本基金的相关费用符合本基金招募说明书和相关公告的规定。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	2026年1月1日至2026年6月30日	2025年1月22日（基金合同生效

			日)至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浦发银行	1,666,783.76	4,398.35	20,027,878.06	114,739.66

6.4.10.7 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 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：股/张）	总金额
国泰海通证券	688635	长进光子	网下申购	1,193	48,889.14
国泰海通证券	301599	理奇智能	网下申购	3,323	46,222.93
国泰海通证券	688781	视涯科技	网下申购	1,287	29,189.16
上年度可比期间 2025 年 1 月 22 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 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：股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有 91,500.00 股托管人公司的 A 股普通股，成本总额为人民币 951,921.02 元，估值总额为人民币 787,815.00 元，占基金资产净值的比例为 0.35%(2025 年 12 月 31 日：持有 187,800.00 股托管人公司的 A 股普通股，成本总额为人民币 2,025,979.49 元，估值总额为人民币 2,336,232.00 元，占基金资产净值的比例为 0.58%)。

于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有 77,096.00 股国泰海通的 A 股普通股，成本总额为人民币 1,486,899.40 元，估值总额为人民币 1,403,147.20 元，占基金资产净值的比例为 0.62%(2025 年 12 月 31 日：持有 156,796.00 股国泰海通的 A 股普通股，成本总额为人民币 3,234,300.35 元，估值总额为人民币 3,222,157.80 元，占基金资产净值的比例为 0.80%)。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
001220	世盟股份	2026-01-27	6 个月	新股锁定	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001248	华润新能源	2026-06-24	1 个月内(含)	新股未上市	10.11	10.11	3,448	34,859.28	34,859.28	-
001248	华润新能源	2026-06-24	6 个月	新股未上市并锁定	10.11	10.11	8,046	81,345.06	81,345.06	-
001257	盛龙股份	2026-03-24	6 个月	新股锁定	7.82	20.74	1,091	8,531.62	22,627.34	-
001312	福恩股份	2026-04-14	6 个月	新股锁定	18.38	16.78	96	1,764.48	1,610.88	-
001365	天海电子	2026-05-11	6 个月	新股锁定	27.19	31.31	281	7,640.39	8,798.11	-
001393	维通利	2026-05-08	6 个月	新股锁定	30.38	38.99	198	6,015.24	7,720.02	-
301513	尚水智能	2026-04-10	6 个月	新股锁定	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春光集团	2026-04-28	6 个月	新股锁定	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026-04-22	6 个月	新股锁定	13.91	32.47	333	4,632.03	10,812.51	-
301669	高特电子	2026-06-02	6 个月	新股锁定	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301682	宏明电子	2026-03-18	6 个月	新股锁定	69.66	160.06	255	17,763.30	40,815.30	-
603284	林平发展	2026-02-03	6 个月	新股锁定	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6 个月	新股锁定	33.49	33.93	48	1,607.52	1,628.64	-
603352	至信股份	2026-01-08	6 个月	新股锁定	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603407	长裕集团	2026-04-29	6 个月	新股锁定	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-

603459	红板科技	2026-03-31	6 个月	新股锁定	17.70	84.32	172	3,044.40	14,503.04	-
688635	长进光子	2026-05-20	6 个月	新股锁定	40.98	308.19	120	4,917.60	36,982.80	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6 个月	新股锁定	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688781	视涯科技	2026-03-18	6 个月	新股锁定	22.68	47.61	515	11,680.20	24,519.15	-
688785	恒运昌	2026-01-20	6 个月	新股锁定	92.18	463.15	98	9,033.64	45,388.70	-
688797	臻宝科技	2026-06-16	6 个月	新股锁定	44.56	468.67	95	4,233.20	44,523.65	-
688811	有研复材	2026-04-01	6 个月	新股锁定	6.41	24.13	823	5,275.43	19,858.99	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6 个月	新股锁定	26.28	172.09	198	5,203.44	34,073.82	-
688816	易思维	2026-02-04	6 个月	新股锁定	55.95	57.10	159	8,896.05	9,078.90	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6 个月	新股锁定	19.68	141.49	386	7,596.48	54,615.14	-

6.4.12.2 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 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026-06-29	重大事项停牌	832.00	2026-07-13	890.99	1,436	372,413.91	1,194,752.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期内未发生转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金，紧密跟踪中证 A500 指数，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，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。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象，采用完全复制法，跟踪中证 A500 指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立审计委员会，负责制定公司的风险管理政策，审议批准公司的风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额及监督公司内部控制制度和风险管理制度的执行情况等；在管理层层面设立风险管理委员会，负责实施董事会下设审计委员会所制定的各项风险管理政策。

本基金的基金管理人建立了由督察长、风险管理委员会、风险管理部和督察稽核部及相关业务部门风险管理责任人构成的三层次风险管理架构体系。

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。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放于信用良好的银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 6.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分投资品种均能及时变现。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等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。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市。部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。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。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足

额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,666,783.76	-	-	-	1,666,783.76
结算备付金	435,225.79	-	-	-	435,225.79
存出保证金	59,930.02	-	-	-	59,930.02
交易性金融资产	-	-	-	225,003,897.85	225,003,897.85
其他资产	-	-	-	60,492.63	60,492.63
资产总计	2,161,939.57	-	-	225,064,390.48	227,226,330.05
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	28,406.79	28,406.79
应付托管费	-	-	-	9,468.93	9,468.93

其他负债	-	-	-	1,022,626.34	1,022,626.34
负债总计	-	-	-	1,060,502.06	1,060,502.06
利率敏感度缺口	2,161,939.57	-	-	224,003,888.42	226,165,827.99
上年度末 2025 年 12 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	5,696,042.05	-	-	-	5,696,042.05
结算备付金	822,111.98	-	-	-	822,111.98
存出保证金	92,012.70	-	-	-	92,012.70
交易性金融资产	-	-	-	402,967,400.96	402,967,400.96
应收清算款	-	-	-	1,815,718.66	1,815,718.66
资产总计	6,610,166.73	-	-	404,783,119.62	411,393,286.35
负债					
应付清算款	-	-	-	1,203,862.55	1,203,862.55
应付管理人报酬	-	-	-	60,310.24	60,310.24
应付托管费	-	-	-	20,103.40	20,103.40
应交税费	-	-	-	12.82	12.82
其他负债	-	-	-	5,247,299.43	5,247,299.43
负债总计	-	-	-	6,531,588.44	6,531,588.44
利率敏感度缺口	6,610,166.73	-	-	398,251,531.18	404,861,697.91

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2025 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2025 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 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交易的股票，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。

本基金采用完全复制法，跟踪中证 A500 指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中，投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。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，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	225,003,897.85	99.49	402,967,400.96	99.53
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

合计	225,003,897.85	99.49	402,967,400.96	99.53
----	----------------	-------	----------------	-------

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 6.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	13,622,225.15	23,552,665.64
	2.业绩比较基准下降 5%	-13,622,225.15	-23,552,665.64

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

- 第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；
- 第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；
- 第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	223,207,903.50	400,110,860.25
第二层次	1,310,956.34	2,856,540.71
第三层次	485,038.01	-
合计	225,003,897.85	402,967,400.96

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券等，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，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间

及限售期间不会将相关股票和债券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（2025 年 12 月 31 日：无）。

6.4.14.4 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工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	225,003,897.85	99.02
	其中：股票	225,003,897.85	99.02
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	2,102,009.55	0.93
8	其他各项资产	120,422.65	0.05
9	合计	227,226,330.05	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	674,306.00	0.30
B	采矿业	9,241,741.00	4.09
C	制造业	158,750,276.26	70.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,811,735.17	2.13
E	建筑业	2,669,783.15	1.18
F	批发和零售业	1,667,641.00	0.74
G	交通运输、仓储和邮政业	4,976,612.42	2.20
H	住宿和餐饮业	68,159.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,796,323.88	5.66
J	金融业	21,871,404.00	9.67
K	房地产业	1,177,047.40	0.52
L	租赁和商务服务业	1,615,255.40	0.71
M	科学研究和技术服务业	2,716,082.00	1.20
N	水利、环境和公共设施管理业	341,511.38	0.15
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	54,180.00	0.02
Q	卫生和社会工作	418,381.44	0.18
R	文化、体育和娱乐业	170,902.00	0.08
S	综合	381,314.00	0.17
	合计	224,402,655.50	99.22

7.2.2 积极投资期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-

B	采矿业	22,627.34	0.01
C	制造业	460,827.21	0.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	116,204.34	0.05
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,583.46	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
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	-	-
	合计	601,242.35	0.27

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300308	中际旭创	7,700	9,779,000.00	4.32
2	300750	宁德时代	18,080	7,105,620.80	3.14
3	300502	新易盛	9,496	5,764,072.00	2.55

4	600519	贵州茅台	4,200	4,979,058.00	2.20
5	603986	兆易创新	4,500	3,667,500.00	1.62
6	601318	中国平安	72,251	3,449,262.74	1.53
7	688256	寒武纪	2,161	3,447,983.55	1.52
8	600036	招商银行	84,030	2,983,065.00	1.32
9	601899	紫金矿业	112,000	2,815,680.00	1.24
10	002371	北方华创	2,900	2,565,224.00	1.13
11	000333	美的集团	33,100	2,500,043.00	1.11
12	002475	立讯精密	34,528	2,430,771.20	1.07
13	688008	澜起科技	7,772	2,408,542.80	1.06
14	688012	中微公司	5,014	2,349,059.00	1.04
15	688041	海光信息	6,189	2,291,786.70	1.01
16	002384	东山精密	8,600	2,256,210.00	1.00
17	600900	长江电力	82,900	2,194,363.00	0.97
18	688981	中芯国际	13,777	2,188,063.14	0.97
19	000725	京东方 A	248,300	2,155,244.00	0.95
20	603259	药明康德	16,900	2,104,219.00	0.93
21	601166	兴业银行	114,800	1,901,088.00	0.84
22	600030	中信证券	66,050	1,897,616.50	0.84
23	300059	东方财富	86,912	1,771,266.56	0.78
24	600183	生益科技	9,800	1,699,320.00	0.75
25	600276	恒瑞医药	30,320	1,577,852.80	0.70
26	300274	阳光电源	9,860	1,567,937.20	0.69
27	601398	工商银行	219,600	1,552,572.00	0.69
28	300408	三环集团	9,038	1,508,442.20	0.67
29	002594	比亚迪	18,600	1,482,420.00	0.66
30	600487	亨通光电	13,200	1,443,288.00	0.64
31	300476	胜宏科技	4,100	1,420,363.00	0.63
32	601211	国泰海通	77,096	1,403,147.20	0.62
33	002463	沪电股份	9,000	1,375,200.00	0.61
34	688498	源杰科技	723	1,363,578.00	0.60
35	688525	佰维存储	2,736	1,353,581.28	0.60
36	300394	天孚通信	4,400	1,331,792.00	0.59
37	000988	华工科技	6,900	1,273,809.00	0.56
38	301308	江波龙	1,800	1,266,840.00	0.56
39	600176	中国巨石	16,400	1,195,232.00	0.53
40	688072	拓荆科技	1,436	1,194,752.00	0.53
41	601288	农业银行	195,200	1,184,864.00	0.52
42	601328	交通银行	181,100	1,164,473.00	0.51
43	000651	格力电器	30,900	1,158,750.00	0.51
44	688521	芯原股份	3,116	1,156,472.24	0.51
45	600522	中天科技	18,300	1,110,444.00	0.49
46	603019	中科曙光	9,900	1,061,577.00	0.47
47	603993	洛阳钼业	59,900	1,051,245.00	0.46

48	600887	伊利股份	42,978	1,029,752.88	0.46
49	600150	中国船舶	30,337	1,025,087.23	0.45
50	600584	长电科技	9,700	1,004,435.00	0.44
51	688347	华虹宏力	2,960	995,448.00	0.44
52	000338	潍柴动力	36,500	994,625.00	0.44
53	300604	长川科技	2,900	990,118.00	0.44
54	000858	五粮液	12,800	947,200.00	0.42
55	688120	华海清科	2,874	925,945.32	0.41
56	002916	深南电路	2,010	920,379.00	0.41
57	601816	京沪高铁	198,125	897,506.25	0.40
58	600309	万华化学	12,900	882,489.00	0.39
59	300124	汇川技术	13,025	863,948.25	0.38
60	002008	大族激光	5,700	855,627.00	0.38
61	600111	北方稀土	17,300	831,265.00	0.37
62	000100	TCL 科技	142,200	827,604.00	0.37
63	002415	海康威视	24,100	824,220.00	0.36
64	002281	光迅科技	3,200	822,208.00	0.36
65	300136	信维通信	6,700	798,975.00	0.35
66	000063	中兴通讯	21,900	792,561.00	0.35
67	600000	浦发银行	91,500	787,815.00	0.35
68	600089	特变电工	33,800	760,500.00	0.34
69	300857	协创数据	2,200	747,780.00	0.33
70	601857	中国石油	84,700	735,196.00	0.33
71	601088	中国神华	18,500	722,240.00	0.32
72	300433	蓝思科技	13,300	713,678.00	0.32
73	002028	思源电气	4,100	709,300.00	0.31
74	600549	厦门钨业	8,100	690,120.00	0.31
75	600031	三一重工	39,400	680,832.00	0.30
76	601601	中国太保	23,400	667,368.00	0.30
77	300014	亿纬锂能	10,200	663,306.00	0.29
78	000792	盐湖股份	21,950	662,670.50	0.29
79	300475	香农芯创	2,200	660,000.00	0.29
80	002050	三花智控	14,900	653,067.00	0.29
81	000001	平安银行	64,900	652,245.00	0.29
82	600406	国电南瑞	28,282	646,243.70	0.29
83	002353	杰瑞股份	4,200	640,500.00	0.28
84	002714	牧原股份	18,000	629,820.00	0.28
85	300223	北京君正	2,500	622,250.00	0.28
86	002156	通富微电	8,078	612,877.86	0.27
87	601668	中国建筑	140,800	611,072.00	0.27
88	000657	中钨高新	6,200	593,464.00	0.26
89	002436	兴森科技	11,600	591,020.00	0.26
90	601919	中远海控	43,100	571,506.00	0.25
91	600660	福耀玻璃	11,100	559,884.00	0.25

92	002602	世纪华通	39,600	558,360.00	0.25
93	300757	罗博特科	900	557,100.00	0.25
94	601728	中国电信	106,700	553,773.00	0.24
95	603501	豪威集团	5,800	550,130.00	0.24
96	300033	同花顺	2,260	544,660.00	0.24
97	601988	中国银行	95,200	544,544.00	0.24
98	601225	陕西煤业	26,700	543,345.00	0.24
99	300760	迈瑞医疗	4,000	543,320.00	0.24
100	300054	鼎龙股份	5,100	540,447.00	0.24
101	600941	中国移动	6,261	539,259.93	0.24
102	002230	科大讯飞	13,200	539,088.00	0.24
103	601012	隆基绿能	41,000	537,920.00	0.24
104	002352	顺丰控股	16,900	528,294.00	0.23
105	000977	浪潮信息	7,400	518,000.00	0.23
106	002938	鹏鼎控股	4,865	512,673.70	0.23
107	002460	赣锋锂业	7,800	510,120.00	0.23
108	600690	海尔智家	24,544	500,943.04	0.22
109	601985	中国核电	54,919	495,918.57	0.22
110	603799	华友钴业	10,251	494,713.26	0.22
111	600160	巨化股份	9,000	477,090.00	0.21
112	300442	润泽科技	5,700	473,499.00	0.21
113	002709	天赐材料	9,161	471,150.23	0.21
114	688777	中控技术	3,958	465,065.00	0.21
115	688002	睿创微纳	2,923	452,158.87	0.20
116	002851	麦格米特	2,700	451,386.00	0.20
117	601600	中国铝业	54,800	450,456.00	0.20
118	000425	徐工机械	55,400	448,186.00	0.20
119	600938	中国海油	16,500	447,975.00	0.20
120	688126	沪硅产业	11,215	447,366.35	0.20
121	300567	精测电子	1,400	444,640.00	0.20
122	000938	紫光股份	15,376	443,751.36	0.20
123	002466	天齐锂业	7,200	441,504.00	0.20
124	600028	中国石化	97,600	435,296.00	0.19
125	002600	领益智造	24,500	424,830.00	0.19
126	002138	顺络电子	5,800	423,980.00	0.19
127	002185	华天科技	19,000	423,890.00	0.19
128	688017	绿的谐波	1,014	423,710.04	0.19
129	600050	中国联通	105,500	422,000.00	0.19
130	601766	中国中车	80,500	418,600.00	0.19
131	002202	金风科技	17,500	418,250.00	0.18
132	002049	紫光国微	4,655	413,131.25	0.18
133	002837	英维克	5,170	411,325.20	0.18
134	600460	士兰微	7,500	409,950.00	0.18
135	600879	航天电子	19,100	406,639.00	0.18

136	002080	中材科技	4,500	405,000.00	0.18
137	002241	歌尔股份	17,900	403,287.00	0.18
138	601628	中国人寿	11,400	402,990.00	0.18
139	603288	海天味业	12,100	401,236.00	0.18
140	601872	招商轮船	22,800	400,596.00	0.18
141	300346	南大光电	4,320	400,248.00	0.18
142	002179	中航光电	8,574	396,118.80	0.18
143	300661	圣邦股份	2,720	390,265.60	0.17
144	002407	多氟多	7,700	386,771.00	0.17
145	000408	藏格矿业	5,500	381,260.00	0.17
146	601658	邮储银行	76,100	375,173.00	0.17
147	000568	泸州老窖	4,800	372,096.00	0.16
148	688111	金山办公	1,741	370,920.05	0.16
149	601888	中国中免	6,900	370,599.00	0.16
150	601006	大秦铁路	80,097	369,247.17	0.16
151	601100	恒立液压	3,400	365,704.00	0.16
152	605117	德业股份	3,388	359,737.84	0.16
153	688469	芯联集成	33,900	359,679.00	0.16
154	600905	三峡能源	96,100	356,531.00	0.16
155	002625	光启技术	11,700	354,744.00	0.16
156	601127	赛力斯	5,700	349,125.00	0.15
157	300395	菲利华	2,600	347,698.00	0.15
158	600893	航发动力	8,900	341,226.00	0.15
159	688396	华润微	3,479	339,376.45	0.15
160	600010	包钢股份	152,100	339,183.00	0.15
161	600673	东阳光	10,100	339,158.00	0.15
162	300751	迈为股份	1,200	338,952.00	0.15
163	000630	铜陵有色	53,200	338,352.00	0.15
164	002027	分众传媒	69,800	337,832.00	0.15
165	300390	天华新能	3,600	336,636.00	0.15
166	600489	中金黄金	18,600	335,730.00	0.15
167	601689	拓普集团	5,900	332,878.00	0.15
168	600019	宝钢股份	59,800	324,714.00	0.14
169	600362	江西铜业	7,400	320,420.00	0.14
170	300058	蓝色光标	23,140	318,406.40	0.14
171	688099	晶晨股份	3,070	315,903.00	0.14
172	300037	新宙邦	3,400	315,690.00	0.14
173	000960	锡业股份	7,300	311,637.00	0.14
174	300450	先导智能	7,600	309,472.00	0.14
175	601168	西部矿业	11,400	309,396.00	0.14
176	600760	中航沈飞	7,500	308,250.00	0.14
177	601727	上海电气	44,000	308,000.00	0.14
178	600988	赤峰黄金	11,700	307,944.00	0.14
179	600104	上汽集团	31,400	306,464.00	0.14

180	002273	水晶光电	8,600	305,128.00	0.13
181	600118	中国卫星	3,700	303,585.00	0.13
182	000538	云南白药	6,380	302,220.60	0.13
183	002422	科伦药业	7,800	300,456.00	0.13
184	002001	新和成	10,520	298,978.40	0.13
185	000426	兴业银锡	9,000	296,640.00	0.13
186	688271	联影医疗	2,923	295,895.29	0.13
187	601390	中国中铁	70,900	295,653.00	0.13
188	600875	东方电气	10,200	293,454.00	0.13
189	605589	圣泉集团	4,600	292,422.00	0.13
190	002648	卫星化学	12,400	291,276.00	0.13
191	000807	云铝股份	13,000	287,820.00	0.13
192	600989	宝丰能源	14,100	286,653.00	0.13
193	600585	海螺水泥	16,900	286,455.00	0.13
194	600547	山东黄金	12,400	286,316.00	0.13
195	002126	银轮股份	5,700	283,860.00	0.13
196	002129	TCL 中环	23,100	277,662.00	0.12
197	002738	中矿资源	4,700	277,253.00	0.12
198	600418	江淮汽车	10,700	276,381.00	0.12
199	600885	宏发股份	7,990	275,575.10	0.12
200	601669	中国电建	58,500	274,950.00	0.12
201	000831	中国稀土	4,900	271,901.00	0.12
202	600795	国电电力	58,100	271,327.00	0.12
203	600667	太极实业	9,200	268,456.00	0.12
204	002195	岩山科技	40,500	264,870.00	0.12
205	300015	爱尔眼科	32,044	264,683.44	0.12
206	600392	盛和资源	8,800	261,976.00	0.12
207	601179	中国西电	17,500	261,100.00	0.12
208	002812	恩捷股份	3,900	260,949.00	0.12
209	605499	东鹏饮料	2,100	259,203.00	0.11
210	600482	中国动力	7,900	259,120.00	0.11
211	600096	云天化	8,500	258,400.00	0.11
212	300418	昆仑万维	6,400	258,304.00	0.11
213	600580	卧龙电驱	7,600	251,560.00	0.11
214	600436	片仔癀	2,300	251,344.00	0.11
215	600141	兴发集团	5,300	248,941.00	0.11
216	600497	驰宏锌锗	20,500	248,255.00	0.11
217	002821	凯莱英	1,500	243,000.00	0.11
218	000066	中国长城	12,500	238,125.00	0.11
219	600157	永泰能源	147,500	237,475.00	0.11
220	600048	保利发展	51,100	236,593.00	0.10
221	002532	天山铝业	22,000	236,060.00	0.10
222	300316	晶盛机电	3,900	235,560.00	0.10
223	600346	恒力石化	13,300	235,543.00	0.10

224	301358	湖南裕能	3,100	235,197.00	0.10
225	000625	长安汽车	32,800	235,176.00	0.10
226	300782	卓胜微	2,131	233,514.98	0.10
227	600221	海航控股	172,900	233,415.00	0.10
228	000933	神火股份	11,000	233,200.00	0.10
229	688047	龙芯中科	1,504	232,623.68	0.10
230	600426	华鲁恒升	9,700	232,024.00	0.10
231	300017	网宿科技	17,700	230,277.00	0.10
232	603129	春风动力	900	230,220.00	0.10
233	000301	东方盛虹	20,100	230,145.00	0.10
234	601058	赛轮轮胎	19,900	229,447.00	0.10
235	002074	国轩高科	8,300	228,333.00	0.10
236	600711	盛屯矿业	20,800	228,176.00	0.10
237	601868	中国能建	85,400	228,018.00	0.10
238	688213	思特威	2,123	227,309.61	0.10
239	600886	国投电力	17,060	227,068.60	0.10
240	002558	巨人网络	8,200	225,992.00	0.10
241	600352	浙江龙盛	18,600	225,246.00	0.10
242	000157	中联重科	32,300	225,131.00	0.10
243	002456	欧菲光	23,700	224,202.00	0.10
244	688578	艾力斯	2,042	222,986.40	0.10
245	600115	中国东航	58,500	222,885.00	0.10
246	600011	华能国际	29,100	220,869.00	0.10
247	002340	格林美	33,400	220,774.00	0.10
248	688235	百济神州	861	219,219.21	0.10
249	600570	恒生电子	10,200	216,138.00	0.10
250	002131	利欧股份	45,500	216,125.00	0.10
251	300339	润和软件	5,600	215,656.00	0.10
252	002493	荣盛石化	20,000	215,000.00	0.10
253	688122	西部超导	3,418	214,684.58	0.09
254	603659	璞泰来	7,400	214,082.00	0.09
255	003816	中国广核	54,700	213,877.00	0.09
256	600026	中远海能	11,900	213,486.00	0.09
257	600066	宇通客车	7,900	211,799.00	0.09
258	300803	指南针	2,300	210,841.00	0.09
259	000975	山金国际	12,100	205,700.00	0.09
260	601877	正泰电器	8,200	205,574.00	0.09
261	600143	金发科技	13,300	205,485.00	0.09
262	300759	康龙化成	7,100	205,403.00	0.09
263	601233	桐昆股份	9,400	203,510.00	0.09
264	600438	通威股份	16,700	202,237.00	0.09
265	002555	三七互娱	10,600	200,022.00	0.09
266	002601	龙佰集团	12,100	199,408.00	0.09
267	688036	传音控股	3,364	198,307.80	0.09

268	600895	张江高科	5,300	197,425.00	0.09
269	002517	恺英网络	12,100	196,625.00	0.09
270	002128	电投能源	8,500	196,520.00	0.09
271	600029	南方航空	37,150	192,437.00	0.09
272	600233	圆通速递	12,200	192,150.00	0.08
273	688266	泽璟制药	1,634	190,622.44	0.08
274	601360	三六零	21,900	190,311.00	0.08
275	002236	大华股份	11,500	189,635.00	0.08
276	300458	全志科技	4,800	189,408.00	0.08
277	002155	湖南黄金	7,900	188,573.00	0.08
278	600219	南山铝业	47,100	187,929.00	0.08
279	601186	中国铁建	31,477	187,288.15	0.08
280	600372	中航机载	17,100	185,535.00	0.08
281	300001	特锐德	4,900	185,367.00	0.08
282	300207	欣旺达	9,700	184,203.00	0.08
283	300454	深信服	1,900	182,780.00	0.08
284	600009	上海机场	7,900	182,490.00	0.08
285	300438	鹏辉能源	2,200	182,270.00	0.08
286	002920	德赛西威	2,200	179,300.00	0.08
287	000768	中航西飞	8,700	178,176.00	0.08
288	000963	华东医药	6,300	177,156.00	0.08
289	688506	百利天恒	602	177,006.06	0.08
290	601117	中国化学	24,000	176,400.00	0.08
291	603650	彤程新材	1,800	176,364.00	0.08
292	002595	豪迈科技	3,695	172,187.00	0.08
293	300763	锦浪科技	1,900	171,665.00	0.08
294	600415	小商品城	16,800	170,688.00	0.08
295	002472	双环传动	4,100	170,191.00	0.08
296	301236	软通动力	4,000	169,800.00	0.08
297	600741	华域汽车	10,900	169,168.00	0.07
298	300012	华测检测	12,200	169,092.00	0.07
299	688676	金盘科技	1,993	168,687.52	0.07
300	688331	荣昌生物	1,290	168,035.40	0.07
301	300115	长盈精密	6,000	167,640.00	0.07
302	600839	四川长虹	24,000	167,520.00	0.07
303	300866	安克创新	1,600	167,200.00	0.07
304	601111	中国国航	27,500	166,375.00	0.07
305	002465	海格通信	13,000	166,010.00	0.07
306	300083	创世纪	12,000	163,440.00	0.07
307	600674	川投能源	11,500	162,955.00	0.07
308	300724	捷佳伟创	2,300	162,380.00	0.07
309	600196	复星医药	7,200	161,784.00	0.07
310	002414	高德红外	12,200	161,772.00	0.07
311	002252	上海莱士	36,500	158,410.00	0.07

312	002497	雅化集团	7,700	156,849.00	0.07
313	002432	九安医疗	2,200	155,496.00	0.07
314	002078	太阳纸业	12,300	153,627.00	0.07
315	601319	中国人保	22,700	153,452.00	0.07
316	002025	航天电器	2,000	152,440.00	0.07
317	300568	星源材质	8,100	151,632.00	0.07
318	601615	明阳智能	13,100	151,567.00	0.07
319	000786	北新建材	8,300	150,147.00	0.07
320	001979	招商蛇口	23,300	149,819.00	0.07
321	600039	四川路桥	19,100	149,362.00	0.07
322	300142	沃森生物	11,300	146,787.00	0.06
323	688608	恒玄科技	869	145,288.11	0.06
324	300474	景嘉微	2,400	145,152.00	0.06
325	600699	均胜电子	6,700	144,787.00	0.06
326	688169	石头科技	1,518	144,164.46	0.06
327	002444	巨星科技	4,600	143,060.00	0.06
328	000878	云南铜业	8,900	141,332.00	0.06
329	000547	航天发展	7,300	139,795.00	0.06
330	300347	泰格医药	2,900	139,200.00	0.06
331	000002	万科 A	47,000	139,120.00	0.06
332	002756	永兴材料	2,400	135,936.00	0.06
333	000733	振华科技	2,400	135,936.00	0.06
334	603979	金诚信	2,300	135,769.00	0.06
335	688390	固德威	1,248	135,420.48	0.06
336	300024	机器人	7,000	135,310.00	0.06
337	600226	亨通股份	14,100	135,219.00	0.06
338	002130	沃尔核材	7,100	134,616.00	0.06
339	002271	东方雨虹	11,300	134,131.00	0.06
340	000661	长春高新	2,000	133,200.00	0.06
341	688223	晶科能源	27,987	132,938.25	0.06
342	601021	春秋航空	2,900	132,182.00	0.06
343	300073	当升科技	2,700	129,708.00	0.06
344	601800	中国交建	22,700	129,617.00	0.06
345	300748	金力永磁	4,200	129,570.00	0.06
346	000519	中兵红箭	6,100	128,527.00	0.06
347	002176	江特电机	12,700	127,127.00	0.06
348	600521	华海药业	8,800	126,720.00	0.06
349	688065	凯赛生物	2,615	125,127.75	0.06
350	000623	吉林敖东	7,000	124,110.00	0.05
351	300558	贝达药业	1,900	123,633.00	0.05
352	300496	中科创达	2,000	123,580.00	0.05
353	300432	富临精工	6,100	122,549.00	0.05
354	302132	中航成飞	2,100	122,472.00	0.05
355	688188	柏楚电子	1,144	122,064.80	0.05

356	300972	万辰集团	700	121,387.00	0.05
357	601618	中国中冶	49,700	121,268.00	0.05
358	000617	中油资本	18,400	121,256.00	0.05
359	000034	神州数码	4,360	120,990.00	0.05
360	603806	福斯特	7,180	120,552.20	0.05
361	600177	雅戈尔	15,600	117,468.00	0.05
362	600588	用友网络	12,700	116,586.00	0.05
363	603260	合盛硅业	2,400	115,824.00	0.05
364	601607	上海医药	7,500	115,500.00	0.05
365	001965	招商公路	12,400	113,584.00	0.05
366	002294	信立泰	3,500	111,615.00	0.05
367	002085	万丰奥威	10,000	110,900.00	0.05
368	601216	君正集团	24,800	110,608.00	0.05
369	000683	博源化工	19,200	110,592.00	0.05
370	002064	华峰化学	11,600	110,084.00	0.05
371	600862	中航高科	6,100	109,983.00	0.05
372	002044	美年健康	21,800	109,654.00	0.05
373	601677	明泰铝业	6,600	109,560.00	0.05
374	000039	中集集团	13,500	109,485.00	0.05
375	600516	方大炭素	17,700	109,209.00	0.05
376	300832	新产业	2,600	109,200.00	0.05
377	000423	东阿阿胶	2,402	108,954.72	0.05
378	601799	星宇股份	1,200	108,744.00	0.05
379	300919	中伟新材	2,480	108,500.00	0.05
380	600515	海南机场	39,500	108,230.00	0.05
381	688599	天合光能	7,632	107,763.84	0.05
382	300251	光线传媒	9,700	107,573.00	0.05
383	688617	惠泰医疗	590	107,120.40	0.05
384	002065	东华软件	15,000	107,100.00	0.05
385	002405	四维图新	16,500	106,755.00	0.05
386	002831	裕同科技	3,000	106,680.00	0.05
387	600803	新奥股份	6,700	105,860.00	0.05
388	603606	东方电缆	2,520	104,605.20	0.05
389	688472	阿特斯	9,612	104,001.84	0.05
390	601633	长城汽车	6,800	102,612.00	0.05
391	600312	平高电气	5,800	102,428.00	0.05
392	600153	建发股份	12,900	102,297.00	0.05
393	603087	甘李药业	1,800	102,168.00	0.05
394	603605	珀莱雅	1,700	101,864.00	0.05
395	603486	科沃斯	2,000	101,500.00	0.04
396	000738	航发控制	5,500	100,595.00	0.04
397	600704	物产中大	21,300	100,536.00	0.04
398	002318	久立特材	4,200	100,380.00	0.04
399	000415	渤海租赁	24,400	99,308.00	0.04

400	000887	中鼎股份	5,500	98,395.00	0.04
401	000400	许继电气	4,530	98,301.00	0.04
402	300676	华大基因	2,800	98,168.00	0.04
403	300573	兴齐眼药	2,403	97,946.28	0.04
404	600166	福田汽车	33,400	97,194.00	0.04
405	002410	广联达	11,900	97,104.00	0.04
406	600085	同仁堂	4,200	97,062.00	0.04
407	600765	中航重机	7,500	96,900.00	0.04
408	688114	华大智造	1,894	96,745.52	0.04
409	300896	爱美客	1,100	95,920.00	0.04
410	002459	晶澳科技	11,800	95,580.00	0.04
411	002266	浙富控股	18,800	95,128.00	0.04
412	688180	君实生物	2,801	94,729.82	0.04
413	603596	伯特利	3,732	92,702.88	0.04
414	002007	华兰生物	7,542	91,936.98	0.04
415	688116	天奈科技	2,400	91,680.00	0.04
416	002603	以岭药业	6,100	91,500.00	0.04
417	600486	扬农化工	1,800	91,260.00	0.04
418	000999	华润三九	4,028	90,589.72	0.04
419	688009	中国通号	18,918	90,049.68	0.04
420	000830	鲁西化工	7,400	88,800.00	0.04
421	300118	东方日升	7,100	88,395.00	0.04
422	600499	科达制造	6,400	88,320.00	0.04
423	600332	白云山	4,405	88,276.20	0.04
424	600398	海澜之家	16,800	87,864.00	0.04
425	300003	乐普医疗	7,370	87,334.50	0.04
426	300677	英科医疗	2,200	86,174.00	0.04
427	600998	九州通	18,300	85,827.00	0.04
428	600161	天坛生物	7,400	85,692.00	0.04
429	688166	博瑞医药	2,418	84,654.18	0.04
430	601018	宁波港	26,300	82,845.00	0.04
431	301550	斯菱智驱	900	82,287.00	0.04
432	601000	唐山港	19,700	81,755.00	0.04
433	300409	道氏技术	4,100	81,713.00	0.04
434	600018	上港集团	17,300	81,656.00	0.04
435	300699	光威复材	2,844	81,480.60	0.04
436	600170	上海建工	36,600	81,252.00	0.04
437	603568	伟明环保	5,251	80,760.38	0.04
438	002223	鱼跃医疗	3,100	79,546.00	0.04
439	600008	首创环保	28,775	78,268.00	0.03
440	600820	隧道股份	14,700	76,587.00	0.03
441	600208	衢州发展	27,000	76,410.00	0.03
442	000932	华菱钢铁	21,800	75,646.00	0.03
443	300342	天银机电	1,600	75,200.00	0.03

444	601238	广汽集团	14,700	74,676.00	0.03
445	002389	航天彩虹	4,200	74,634.00	0.03
446	605090	九丰能源	2,000	74,340.00	0.03
447	603766	隆鑫通用	6,200	73,966.00	0.03
448	000967	盈峰环境	7,000	73,710.00	0.03
449	300122	智飞生物	6,200	72,478.00	0.03
450	600529	山东药玻	3,900	71,955.00	0.03
451	601155	新城控股	6,900	70,794.00	0.03
452	000032	深桑达 A	2,800	69,860.00	0.03
453	688063	派能科技	1,298	69,144.46	0.03
454	688005	容百科技	2,229	68,207.40	0.03
455	603885	吉祥航空	6,600	67,914.00	0.03
456	601880	辽港股份	48,800	67,344.00	0.03
457	600816	建元信托	27,400	66,856.00	0.03
458	600535	天士力	5,000	66,150.00	0.03
459	601567	三星电气	4,400	65,736.00	0.03
460	300144	宋城演艺	10,900	63,329.00	0.03
461	600323	瀚蓝环境	2,300	63,158.00	0.03
462	600004	白云机场	8,400	60,984.00	0.03
463	601866	中远海发	26,900	59,449.00	0.03
464	002120	韵达股份	9,200	58,512.00	0.03
465	000035	中国天楹	12,100	58,443.00	0.03
466	300049	福瑞医科	1,500	58,320.00	0.03
467	603939	益丰药房	3,200	57,536.00	0.03
468	002544	普天科技	3,100	56,482.00	0.02
469	002091	江苏国泰	7,700	55,671.00	0.02
470	600038	中直股份	2,158	54,575.82	0.02
471	002607	中公教育	30,100	54,180.00	0.02
472	603392	万泰生物	2,000	53,940.00	0.02
473	002244	滨江集团	6,814	51,786.40	0.02
474	600859	王府井	5,500	50,490.00	0.02
475	600511	国药股份	1,900	49,476.00	0.02
476	688303	大全能源	2,804	48,873.72	0.02
477	603899	晨光股份	2,300	47,449.00	0.02
478	300601	康泰生物	4,100	46,494.00	0.02
479	600316	洪都航空	1,656	46,268.64	0.02
480	600655	豫园股份	11,200	46,032.00	0.02
481	000069	华侨城 A	27,800	45,592.00	0.02
482	600258	首旅酒店	4,100	44,772.00	0.02
483	002292	奥飞娱乐	6,800	44,608.00	0.02
484	000998	隆平高科	5,900	44,486.00	0.02
485	300100	双林股份	1,600	44,448.00	0.02
486	600763	通策医疗	1,300	44,044.00	0.02
487	300070	碧水源	13,800	44,022.00	0.02

488	002891	中宠股份	1,600	42,752.00	0.02
489	603816	顾家家居	1,900	42,484.00	0.02
490	300457	赢合科技	2,000	42,160.00	0.02
491	000833	粤桂股份	1,800	42,156.00	0.02
492	603833	欧派家居	1,300	39,143.00	0.02
493	600635	大众公用	8,800	37,664.00	0.02
494	600064	南京高科	5,200	37,076.00	0.02
495	600864	哈投股份	7,100	36,849.00	0.02
496	600325	华发股份	14,200	32,802.00	0.01
497	600663	陆家嘴	5,000	31,400.00	0.01
498	301078	孩子王	4,000	27,040.00	0.01
499	600754	锦江酒店	1,300	23,387.00	0.01
500	002572	索菲亚	2,800	20,440.00	0.01

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	001248	华润新能源	11,494	116,204.34	0.05
2	688820	盛合晶微	386	54,615.14	0.02
3	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.02
4	688785	恒运昌	98	45,388.70	0.02
5	688797	臻宝科技	95	44,523.65	0.02
6	301682	宏明电子	255	40,815.30	0.02
7	688635	长进光子	120	36,982.80	0.02
8	688813	泰金新能	198	34,073.82	0.02
9	688781	视涯科技	515	24,519.15	0.01
10	001257	盛龙股份	1,091	22,627.34	0.01
11	688811	有研复材	823	19,858.99	0.01
12	301669	高特电子	546	15,506.40	0.01
13	301531	春光集团	290	14,952.40	0.01
14	603459	红板科技	172	14,503.04	0.01
15	301599	理奇智能	333	10,812.51	0.00
16	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
17	688816	易思维	159	9,078.90	0.00
18	001365	天海电子	281	8,798.11	0.00
19	001393	维通利	198	7,720.02	0.00
20	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
21	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
22	603293	埃泰克	48	1,628.64	0.00
23	001312	福恩股份	96	1,610.88	0.00
24	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00

25	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
----	--------	------	----	----------	------

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	3,431,141.00	0.85
2	002371	北方华创	3,147,863.00	0.78
3	300308	中际旭创	2,523,610.00	0.62
4	300394	天孚通信	2,102,931.00	0.52
5	600519	贵州茅台	1,858,509.00	0.46
6	300502	新易盛	1,739,794.00	0.43
7	688041	海光信息	1,596,364.57	0.39
8	300476	胜宏科技	1,413,148.00	0.35
9	002475	立讯精密	1,315,546.00	0.32
10	000333	美的集团	1,278,856.83	0.32
11	002594	比亚迪	1,261,444.00	0.31
12	002384	东山精密	1,157,159.00	0.29
13	688498	源杰科技	1,024,428.82	0.25
14	000858	五粮液	1,019,081.00	0.25
15	300604	长川科技	1,004,663.00	0.25
16	300223	北京君正	997,845.00	0.25
17	300059	东方财富	979,757.00	0.24
18	301308	江波龙	930,121.00	0.23
19	300274	阳光电源	911,436.00	0.23
20	688525	佰维存储	890,843.69	0.22

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	11,023,279.00	2.72
2	300308	中际旭创	8,716,834.04	2.15
3	300502	新易盛	5,485,503.00	1.35
4	002371	北方华创	4,416,001.00	1.09
5	000333	美的集团	4,276,787.00	1.06
6	002475	立讯精密	3,407,180.00	0.84

7	688256	寒武纪	3,180,579.83	0.79
8	002594	比亚迪	3,040,028.00	0.75
9	300394	天孚通信	3,025,241.00	0.75
10	300059	东方财富	2,950,681.00	0.73
11	300274	阳光电源	2,601,053.64	0.64
12	300476	胜宏科技	2,516,921.00	0.62
13	000858	五粮液	2,369,908.00	0.59
14	002384	东山精密	2,202,581.00	0.54
15	000651	格力电器	1,877,418.00	0.46
16	000725	京东方 A	1,858,954.00	0.46
17	688012	中微公司	1,722,093.91	0.43
18	000338	潍柴动力	1,622,792.00	0.40
19	002028	思源电气	1,609,008.00	0.40
20	002463	沪电股份	1,546,027.00	0.38

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	95,956,204.37
卖出股票的收入（成交）总额	196,915,792.64

注：“买入股票成本”、“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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的。本基金管理人将充分考虑股指期货的流动性及风险收益特征，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行多头或空头套期保值等策略操作。法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。国债期货相关投资严格遵循法律法规及中国证监会的规定。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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在本报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司制度的规定。

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期被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同约定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	59,930.02
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-

6	其他应收款	-
7	待摊费用	60,492.63
8	其他	-
9	合计	120,422.65

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例(%)	流通受限情 况说明
1	001248	华润新能源	81,345.06	0.04	新股未上市 并锁定
2	688820	盛合晶微	54,615.14	0.02	新股锁定流 通受限
3	688712	北芯生命	53,880.00	0.02	新股锁定流 通受限
4	688785	恒运昌	45,388.70	0.02	新股锁定流 通受限
5	688797	臻宝科技	44,523.65	0.02	新股锁定流 通受限
6	001248	华润新能源	34,859.28	0.02	新股未上市

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
360	441,234.17	149,812,300.00	94.31%	9,032,000.00	5.69%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	0.00	0.0000%

注：本基金本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2025 年 1 月 22 日）基金份额总额	1,937,844,300.00
本报告期期初基金份额总额	323,844,300.00
本报告期基金总申购份额	78,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	243,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	158,844,300.00

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：

2026 年 4 月 30 日，海富通基金管理有限公司发布公告，魏峻先生不再担任公司副总经理。

2026 年 5 月 23 日，海富通基金管理有限公司发布公告，总经理任志强先生自 2026 年 5 月 22 日起兼任公司首席信息官，陶网雄先生不再担任公司首席信息官。

基金托管人：

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，无涉及本基金基金管理人基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所为毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)，未有改聘情况发生。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人无受调查或处罚情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	
中信证券	1	198,133,439.42	67.91%	36,833.65	67.91%	-
国泰海通证券	3	56,542,180.70	19.38%	10,511.96	19.38%	-
华泰证券	2	37,079,376.29	12.71%	6,893.41	12.71%	-

注：1、报告期内本基金租用券商交易单元未发生变更。

2、交易单元的选择标准：

基金管理人选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司，租用其交易单元供本基金证券交易。

3、交易单元的选择程序：

（1）由牵头部门依据上述交易单元选择标准及公司内控制度要求，对候选券商开展尽职调查，综合评估其财务状况、经营行为、合规风控能力、交易、研究等服务能力。

（2）经评估，牵头部门将符合公司制度要求的券商相关材料提交督察长进行合规性审查，再提交基金管理人的总经理办公会审议。

（3）基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》。

10.7.2 基金租用或者通过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		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
中信证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	-	-	2,400,000.00	100.00%	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	海富通基金管理有限公司关于旗下部分上交所上市基金变更扩位证券简称的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-21
2	海富通基金管理有限公司关于调整基金经理助理的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-02-11
3	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增金融街证券股份有限公司为申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-02
4	关于海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金新增中国国际金融股份有限公司为	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金	2026-03-02

	申购赎回代办证券公司的公告	电子披露网站	
5	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增粤开证券股份有限公司为申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-10
6	海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-10
7	海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-12
8	海富通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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-19
9	海富通基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况(2025 年度)	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
10	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国中金财富证券有限公司为申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-07
11	海富通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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-23
12	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-30
13	海富通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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-21
14	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-23
15	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华源证券股份有限公司为申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-01
16	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资北京证券交易所上市股票及相关风险提示的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-13
17	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增开源证券股份有限公司为申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-16

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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	1	2026/2/12-2026/6/30	53,295,447.00	-	-	53,295,447.00	33.55%
	2	2026/1/1-2026/2/1	99,581,800.00	-	99,581,800.00	-	-
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括： 1、当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险； 2、若某单一基金份额持有人巨额赎回有可能引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额； 3、若个别投资者大额赎回后，可能会导致基金资产净值连续出现六十个工作日低于5000万元的风险，基金可能会面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形； 4、其他可能的风险。							

注：报告期内单一投资者申购赎回份额包含二级市场交易数据。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

海富通基金管理有限公司成立于 2003 年 4 月，是中国首批获准成立的中外合资基金管理公司。从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 137 只公募基金。截至 2026 年 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 3108 亿元人民币。

海富通是国家人力资源和社会保障部首批企业年金基金投资管理人。2008 年 3 月，海富通获批从事特定客户资产管理业务。2010 年 12 月，海富通被全国社会保障基金理事会选聘为境内委托投资管理人。2012 年 9 月，中国保险监督管理委员会公告确认海富通为首批保险资金投资管理人。2016 年 12 月，海富通被全国社会保障基金理事会选聘为首批基本养老保险基金投资管理人。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一)中国证监会批准设立海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金的文件
- (二)海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- (三)海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书
- (四)海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- (五)中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件

(六)法律法规及中国证监会规定的其他文件

12.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 18 层 1802-1803 室以及 19 层 1901-1908 室

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司

二〇二六年八月三十一日