

海富通中证 500 指数增强型证券投资基金
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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	9
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遵规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
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	14
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	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	50
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	51
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	51
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	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.12 投资组合报告附注	52
§8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
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	53
§9 开放式基金份额变动	53
§10 重大事件揭示	54
10.1 基金份额持有人大会决议	54
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	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4 基金投资策略的改变	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	54
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	54
10.8 其他重大事件	56
§11 影响投资者决策的其他重要信息	56
§12 备查文件目录	57
12.1 备查文件目录	57
12.2 存放地点	57
12.3 查阅方式	58

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	海富通中证 500 增强	
基金主代码	519034	
交易代码	519034	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2020 年 3 月 5 日	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	14,202,026.85 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通中证 500 增强 A	海富通中证 500 增强 C
下属分级基金的交易代码	519034	009004
报告期末下属分级基金的份额总额	11,087,101.13 份	3,114,925.72 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的投资策略模型进行积极的指数组合管理与风险控制，力求实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为增强型指数基金，在采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数基础上通过数量化模型进行投资组合优化，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。 本基金股票资产跟踪的标的指数为中证 500 指数。本基金主要策略为复制目标指数，投资组合将以成份股在目标指数中的基准权重为基础，利用海富通定量投资模型在有限范围内进行超配或低配选择。一方面将严格控制组合跟踪误差，避免大幅偏离目标指数，另一方面在指数跟踪的同时力求超越指数。
业绩比较基准	95%×中证 500 指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。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公司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	中国建设银行股份有限公司
信息披露	姓名	岳冲	王小飞
	联系电话	021-38650788	021-60637103

负责人	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		40088-40099	021-60637228
传真		021-33830166	021-60635778
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	北京市西城区金融大街25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	北京市西城区闹市口大街1号 院1号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		谢乐斌	张金良

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）	
	海富通中证 500 增强 A	海富通中证 500 增强 C
本期已实现收益	3,514,524.30	1,259,602.85
本期利润	4,638,597.16	1,600,620.42
加权平均基金份额本期利润	0.3743	0.3614
本期加权平均净值利润率	15.46%	15.18%
本期基金份额净值增长率	17.81%	17.66%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	

	海富通中证 500 增强 A	海富通中证 500 增强 C
期末可供分配利润	17,831,437.31	4,883,449.53
期末可供分配基金份额利润	1.6083	1.5678
期末基金资产净值	28,918,538.44	7,998,375.25
期末基金份额净值	2.6083	2.5678
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	海富通中证 500 增强 A	海富通中证 500 增强 C
基金份额累计净值增长率	73.89%	68.86%

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

海富通中证 500 增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	14.95%	1.53%	17.61%	1.56%	-2.66%	-0.03%
过去六个月	17.81%	1.51%	19.93%	1.58%	-2.12%	-0.07%
过去一年	44.66%	1.27%	49.68%	1.35%	-5.02%	-0.08%
过去三年	46.22%	1.33%	48.15%	1.41%	-1.93%	-0.08%
过去五年	27.66%	1.26%	31.61%	1.30%	-3.95%	-0.04%
自基金合同生效起至今	73.89%	1.30%	55.62%	1.28%	18.27%	0.02%

海富通中证 500 增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	14.87%	1.53%	17.61%	1.56%	-2.74%	-0.03%
过去六个月	17.66%	1.51%	19.93%	1.58%	-2.27%	-0.07%
过去一年	44.31%	1.27%	49.68%	1.35%	-5.37%	-0.08%
过去三年	45.14%	1.33%	48.15%	1.41%	-3.01%	-0.08%
过去五年	26.08%	1.26%	31.61%	1.30%	-5.53%	-0.04%
自基金合同生效起至今	68.86%	1.30%	55.62%	1.28%	13.24%	0.02%

3.2.2 自基金转型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 500 指数增强型证券投资基金

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

(2020 年 3 月 5 日至 2026 年 6 月 30 日)

海富通中证 500 增强 A



海富通中证 500 增强 C



注：本基金转型日期为 2020 年 3 月 5 日。按照本基金合同规定，本基金建仓期为自基金合同转

型生效起六个月。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。

§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		
李自悟	本基金的基金经理；量化投资部副总监（主持工作）。	2023-02-15	-	18 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。2008 年 4 月至 2010 年 1 月任 MNJ Capital Management 交易员，2010 年 7 月至 2011 年 6 月任 BlackRock 研究员，2011 年 7 月至 2016 年 3 月任国家外汇管理局中央外汇业务中心基金经理，2016 年 3 月至 2019 年 8 月任上海均直资产管理有限公司基金经理，2019 年 9 月至 2022 年 8 月任野村东方国际证券量化投资主管。2022 年 8 月加入海富通基金管理有限公司，现任量化投资部副总监（主持工作）。2023 年 2 月起任海富通中证 500 增强基金经理。2023 年 2 月至 2025 年 3 月兼任海富通量化先锋股票的基金经理。2023 年 4 月起兼任海富通阿尔法对冲混合的基金经理。2024 年 3 月起兼任海富通中证 2000 增强策略 ETF 的基金经理。2024 年 7 月起兼任海富通量化选股混合的基金经理。2025 年 3 月起兼任海富通欣益混合的基金经理。2025 年 12 月起兼任海富通中证 A500 指数增强的基金经理，2026 年 5 月起兼任海富通沪深 300 增强基金经理。
林立禾	本基金的基金经理	2025-01-13	-	7 年	美国密歇根大学定量金融与风险管理硕士，持有基金从业人员资格证书。历任中欧基金管理有限公司风险管理部量化风控岗。2020 年 8 月加入海富通基金管理有限公司，历任量化研究员、量化投资部基金经理助理。2023 年 11 月至 2026 年 1 月任海富通富利三个月持有的基金经理。2023 年 11 月起任海富通沪深 300 增强的基金经理。2023 年 11 月至 2025 年 3 月兼任海富通欣益混合的基金经理。2024 年 10 月至 2025 年 5 月兼任海富通量化多因子混合基金经理。2025 年 1 月起兼任海富通中证 500 指数

					增强基金经理。2025 年 3 月起兼任海富通量化先锋股票、海富通中证 A500 指数增强基金经理。2025 年 6 月起兼任海富通致远量化选股股票发起基金经理。2025 年 8 月起兼任海富通欣享混合、海富通安益对冲混合基金经理。
--	--	--	--	--	--

- 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。
- 3、本公司于 2026 年 7 月 10 日发布公告，自 2026 年 7 月 9 日起增聘朱斌全先生担任本基金的基金经理。
- 4、本公司于 2026 年 8 月 29 日发布公告，自 2026 年 8 月 28 日起林立禾先生不再担任本基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人认真遵循《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

宏观经济方面，上半年国内经济总体平稳、结构持续优化。根据初步核算，上半年国内生产总值 69.6 万亿元，同比增长 4.7%，基本运行在全年目标区间。经济运行基本盘稳固。物价温和回升，CPI 同比上涨，工业领域通缩压力则得到缓解。流动性保持合理充裕。结构上，高端制造与出口成为主要亮点。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贡献率超四成，经济向新向优特征鲜明。上半年出口金额同比增长显著，贸易顺差持续扩大；高技术制造业增加值同比增长明显，特别是新能源汽车、工业机器人等行业。

A 股市场方面，上半年指数走势分化，科技成长板块全面占优。上证指数上涨 3.16%，沪深 300 涨 7.55%，中证 500 涨 20.97%，创业板指涨 35.58%，科创 50 涨 64.25%。申万一级行业中，电子、通信、建筑材料、机械设备涨幅居前，商贸零售、农林牧渔、美容护理、食品饮料表现落后。年初在美联储宽松预期和美国财政脉冲带动下，市场聚焦流动性宽松及经济复苏受益方向。2 月下旬美伊冲突爆发，国际油价飙升，通胀预期强化逆转了美联储的宽松预期。随后，美国科技巨头集中上修 2026 年资本开支，AI 基础设施周期全面启动，AI 主线贯穿二季度并成为核心驱动因素。整体看，上半年市场呈现极致科技成长风格，AI 算力、半导体等细分赛道领涨，结构分化显著。

报告期内，本基金坚持通过多因子量化模型优选个股，通过风险模型控制组合在风格及行业层面相对基准指数的暴露。从因子表现看，动量因子与成长因子表现突出，而低估值因子则出现阶段性回撤。在因子配置上，组合通过因子择时模型适度调整了相关因子的权重，以适应大盘、成长、动量等风格占主导的市场环境。策略层面，我们提升了景气度驱动的基本面量化策略权重，降低了单纯依赖估值回归的深度价值策略占比。风险模型则持续监控组合在各风格上的偏离幅度，在市场风格高度集中于成长方向的环境下，重点防范风格反转可能带来的回撤风险，保持组合的稳健运行。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通中证 500 增强 A 净值增长率为 17.81%，同期业绩比较基准收益率为 19.93%。海富通中证 500 增强 C 净值增长率为 17.66%，同期业绩比较基准收益率为 19.93%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从目前的宏观环境来看，全球 AI 投资浪潮仍在延续，我国相关产业链高景气的现状有望维持。

但是相关股票涨幅较大，积累的获利盘需要认真应对。地缘政治方面，美伊关系的不确定性对油价的影响仍需紧密跟踪。国内经济方面，向新向优趋势不变，企业盈利具备持续改善的基础。流动性方面，国内货币政策维持宽松基调，叠加监管持续引导中长期资金入市，整体流动性环境偏稳定，市场具备震荡上行的条件。我们将继续跟踪国内政策与经济动能变化，把握结构性机会与市场节奏。对于量化策略而言，上半年极致的市场风格并不是最理想的市场环境。随着市场逐步回归理性，我们认为下半年相关策略的表现将更值得期待。

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，在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可对本基金进行基金分红。法律法规或监管机构另有规定的或在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

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

自 2024 年 7 月 8 日至 2026 年 6 月 30 日，本基金连续超过六十个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形。基金管理人已根据法规要求向中国证券监督管理委员会上海监管局报告并提出解决方案。

自 2024 年 10 月 8 日起，由基金管理人承担本基金项下相关固定费用。

§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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,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,本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查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。

§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 500 指数增强型证券投资基金

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	1,359,262.81	507,134.86
结算备付金		661,948.87	707,983.57
存出保证金		222,484.66	7,836.49
交易性金融资产	6.4.7.2	34,802,769.94	38,894,424.20
其中：股票投资		32,883,402.35	36,975,135.10
基金投资		-	-
债券投资		1,919,367.59	1,919,289.10
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		57,094.36	13,414.23
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	32,234.29	65,000.00
资产总计		37,135,794.93	40,195,793.35
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		562.70	173.67
应付赎回款		126,898.84	227,392.15
应付管理人报酬		23,012.18	26,238.73
应付托管费		5,753.08	6,559.69
应付销售服务费		1,564.15	1,965.59
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	9.95
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	61,090.29	84,949.67
负债合计		218,881.24	347,289.45
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	14,202,026.85	18,062,698.95
未分配利润	6.4.7.8	22,714,886.84	21,785,804.95
净资产合计		36,916,913.69	39,848,503.90
负债和净资产总计		37,135,794.93	40,195,793.35

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 2.6083 元，C 类基金份额净值 2.5678 元。
基金份额总额 14,202,026.85 份，其中 A 类基金份额 11,087,101.13 份，C 类基金份额 3,114,925.72 份。

6.2 利润表

会计主体：海富通中证 500 指数增强型证券投资基金

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	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至
----	-----	-----------------------	----------------------------

		2026 年 6 月 30 日	2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		6,453,912.63	2,328,275.30
1.利息收入		4,687.87	9,505.19
其中：存款利息收入	6.4.7.9	4,687.87	2,904.75
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		-	6,600.44
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,972,025.33	1,005,910.67
其中：股票投资收益	6.4.7.10	4,700,506.57	519,968.75
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	13,148.65	7,475.14
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	2,627.59	133,134.97
股利收益	6.4.7.14	255,742.52	345,331.81
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	1,465,090.43	1,308,278.68
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	12,109.00	4,580.76
减：二、营业总支出		214,695.05	165,554.69
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	161,121.21	128,535.71
2. 托管费	6.4.10.2.2	40,280.35	32,133.92
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	13,102.58	4,174.96
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		10.91	505.10
8. 其他费用	6.4.7.17	180.00	205.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,239,217.58	2,162,720.61
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,239,217.58	2,162,720.61
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		6,239,217.58	2,162,720.61

6.3 净资产变动表

会计主体：海富通中证 500 指数增强型证券投资基金

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	18,062,698.95	-	21,785,804.95	39,848,503.90
二、本期期初净资产	18,062,698.95	-	21,785,804.95	39,848,503.90
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3,860,672.10	-	929,081.89	-2,931,590.21
（一）、综合收益总额	-	-	6,239,217.58	6,239,217.58
（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）	-3,860,672.10	-	-5,310,135.69	-9,170,807.79
其中：1.基金申购款	6,081,713.11	-	8,365,170.25	14,446,883.36
2.基金赎回款	-9,942,385.21	-	-13,675,305.94	-23,617,691.15
（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	14,202,026.85	-	22,714,886.84	36,916,913.69
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 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	19,202,599.89	-	13,046,665.72	32,249,265.61
二、本期期初净资产	19,202,599.89	-	13,046,665.72	32,249,265.61
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-545,810.35	-	1,878,319.65	1,332,509.30
（一）、综合收益总额	-	-	2,162,720.61	2,162,720.61

(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)	-545,810.35	-	-284,400.96	-830,211.31
其中: 1.基金申购款	2,410,696.24	-	1,696,240.79	4,106,937.03
2.基金赎回款	-2,956,506.59	-	-1,980,641.75	-4,937,148.34
(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	18,656,789.54	-	14,924,985.37	33,581,774.91

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 500 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)是由原海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金转型而来。原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[2011]1801 号文核准,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法》和《海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 756,109,208.17 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第 154 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金基金合同》于 2012 年 5 月 25 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 756,241,204.93 份基金份额,其中认购资金利息折合 131,996.76 份基金份额。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金基金合同》的有关规定,海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会,于 2020 年 3 月 3 日表决通过了《关于海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金基金合同转型有关事项的议案》。根据《海富通基金

管理有限公司关于海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金基金合同基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，《海富通中证 500 增强指数型证券投资基金基金合同》自 2020 年 3 月 5 日起正式生效，原《海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金基金合同》自同日起失效。于 2020 年 3 月 5 日起，海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金基金合同的基金份额全部转换为海富通中证 500 增强指数型证券投资基金的基金份额。

根据《海富通中证 500 增强指数型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通中证 500 增强指数型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以标的指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可投资于国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板、中小板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票)、存托凭证、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券(包含可分离交易可转换债)、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、股指期货、国债期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金持有的股票及存托凭证投资占基金资产的比例为不低于 80%，其中，投资标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。法律法规或监管机构日后允许本基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 5\% \times \text{银行活期存款利率（税后）}$ 。

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

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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2026 年 6 月 30 日，本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案，故本财务报表以持续经营为基础编制。

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

本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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	1,359,262.81
等于：本金	1,359,141.19
加：应计利息	121.62
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	1,359,262.81

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		30,993,862.05	-	32,883,402.35	1,889,540.30
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所		15,887.59		
	市场	1,905,085.00		1,919,367.59	-1,605.00
	银行间		-		
	市场	-		-	-
	合计	1,905,085.00	15,887.59	1,919,367.59	-1,605.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		32,898,947.05	15,887.59	34,802,769.94	1,887,935.30

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	1,607,120.00	-	-	-
——股指期货	1,607,120.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,607,120.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2609	IC2609	1.00	1,752,280.00	145,160.00
合计	-	-	-	145,160.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	145,160.00
净额	-	-	-	-

注：按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《证券投资基金股指期货投资会计核算业务细则（试行）》及《企业会计准则——金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具——股指期货投资”与“证券清算款——股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具——股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

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	32,234.29
待摊费用	-
合计	32,234.29

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	3.31
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	28,852.69
其中：交易所市场	28,852.69
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	32,234.29
合计	61,090.29

6.4.7.7 实收基金

海富通中证 500 增强 A

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	13,581,255.49	13,581,255.49
本期申购	1,804,118.55	1,804,118.55
本期赎回（以“-”号填列）	-4,298,272.91	-4,298,272.91
本期末	11,087,101.13	11,087,101.13

海富通中证 500 增强 C

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	4,481,443.46	4,481,443.46
本期申购	4,277,594.56	4,277,594.56

本期赎回（以“-”号填列）	-5,644,112.30	-5,644,112.30
本期末	3,114,925.72	3,114,925.72

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

海富通中证 500 增强 A

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	23,326,209.65	-6,838,688.83	16,487,520.82
本期期初	23,326,209.65	-6,838,688.83	16,487,520.82
本期利润	3,514,524.30	1,124,072.86	4,638,597.16
本期基金份额交易产生的变动数	-4,745,561.44	1,450,880.77	-3,294,680.67
其中：基金申购款	3,413,302.32	-874,171.43	2,539,130.89
基金赎回款	-8,158,863.76	2,325,052.20	-5,833,811.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	22,095,172.51	-4,263,735.20	17,831,437.31

海富通中证 500 增强 C

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	7,556,565.66	-2,258,281.53	5,298,284.13
本期期初	7,556,565.66	-2,258,281.53	5,298,284.13
本期利润	1,259,602.85	341,017.57	1,600,620.42
本期基金份额交易产生的变动数	-2,727,937.46	712,482.44	-2,015,455.02
其中：基金申购款	7,888,282.21	-2,062,242.85	5,826,039.36
基金赎回款	-10,616,219.67	2,774,725.29	-7,841,494.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,088,231.05	-1,204,781.52	4,883,449.53

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	1,611.24
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	3,056.01
其他	20.62
合计	4,687.87

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	183,272,691.83
减：卖出股票成本总额	178,391,474.90
减：交易费用	180,710.36
买卖股票差价收入	4,700,506.57

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	13,059.81
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	88.84
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	13,148.65

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,127,998.52
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,100,151.16
减：应计利息总额	27,758.52
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	88.84

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

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股指期货投资收益（税前）	3,120.00
减：股指期货差价收入应缴纳增值税额	90.87
减：交易费用	401.54
合计	2,627.59

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	255,742.52
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	255,742.52

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	1,319,930.43
——股票投资	1,322,064.27
——债券投资	-2,133.84
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	145,160.00
——权证投资	-
——股指期货	145,160.00
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	1,465,090.43

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	12,086.56
基金转换费收入	22.44
合计	12,109.00

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	-
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行划款手续费	180.00
合计	180.00

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
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金销售机构
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	上年度可比期间
-------	----	---------

	2026年1月1日至2026年6月30日		2025年1月1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	311,634,005.14	87.48%	50,397,636.06	27.30%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

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	57,933.89	87.48%	28,852.69	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1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
国泰海通证券	9,365.39	27.30%	7,317.45	52.28%

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1日至2025年6 月30日

当期发生的基金应支付的管理费	161,121.21	128,535.71
其中：应支付销售机构的客户维护费	77,043.64	54,802.87
应支付基金管理人的净管理费	84,077.57	73,732.84

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 0.80%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 x0.80%/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1日至2025年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	40,280.35	32,133.92

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20%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 x0.20%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通中证 500 增强 A	海富通中证 500 增强 C	合计
海富通	-	426.69	426.69
国泰海通证券	-	8.35	8.35
合计	-	435.04	435.04
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通中证500增强 A	海富通中证500增强C	合计
海通证券	-	0.73	0.73
海富通	-	270.87	270.87
国泰海通证券	-	2.16	2.16
合计	-	273.76	273.76

注：本基金 A 类份额不收取销售服务费，C 类份额的基金销售服务费年费率为 0.25%，基金销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.25%年费率计提，逐日累计至每月月底,按月支付。销售服务费的计算方法如下：日销售服务费=前一日 C 类份额的基金资产净值 x0.25%/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

本基金本报告期及上年度可比期间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**

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

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**

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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1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
中国建设银行	1,359,262.81	1,611.24	74,779.08	829.89

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

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
001248	华润新能源	2026-06-25	1 个月内（含）	新股未上市	10.11	10.11	1,000	10,110.00	10,110.00	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

本基金为指数增强型基金，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。本基金投资的金融工具主要为股票投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	911,362.93	1,919,289.10
合计	911,362.93	1,919,289.10

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。未评级部分一般为国债、政策性金融债、央票、无第三方评级机构评级的债券。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末	上年度末
--------	-----	------

	2026年6月30日	2025年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	1,008,004.66	-
合计	1,008,004.66	-

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。未评级部分一般为国债、政策性金融债、央票、无第三方评级机构评级的债券。

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公司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，其余亦可在银行间同业市场交易，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	1,359,262.81	-	-	-	1,359,262.81
结算备付金	661,948.87	-	-	-	661,948.87
存出保证金	12,211.06	-	-	210,273.60	222,484.66

交易性金融资产	1,919,367.59	-	-	32,883,402.35	34,802,769.94
应收申购款	-	-	-	57,094.36	57,094.36
其他资产	-	-	-	32,234.29	32,234.29
资产总计	3,952,790.33	-	-	33,183,004.60	37,135,794.93
负债					
应付清算款	-	-	-	562.70	562.70
应付赎回款	-	-	-	126,898.84	126,898.84
应付管理人报酬	-	-	-	23,012.18	23,012.18
应付托管费	-	-	-	5,753.08	5,753.08
应付销售服务费	-	-	-	1,564.15	1,564.15
其他负债	-	-	-	61,090.29	61,090.29
负债总计	-	-	-	218,881.24	218,881.24
利率敏感度缺口	3,952,790.33	-	-	32,964,123.36	36,916,913.69
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	507,134.86	-	-	-	507,134.86
结算备付金	707,983.57	-	-	-	707,983.57
存出保证金	7,836.49	-	-	-	7,836.49
交易性金融资产	1,919,289.10	-	-	36,975,135.10	38,894,424.20
应收申购款	-	-	-	13,414.23	13,414.23
其他资产	-	-	-	65,000.00	65,000.00
资产总计	3,142,244.02	-	-	37,053,549.33	40,195,793.35
负债					
应付清算款	-	-	-	173.67	173.67
应付赎回款	-	-	-	227,392.15	227,392.15
应付管理人报酬	-	-	-	26,238.73	26,238.73
应付托管费	-	-	-	6,559.69	6,559.69
应付销售服务费	-	-	-	1,965.59	1,965.59
应交税费	-	-	-	9.95	9.95
其他负债	-	-	-	84,949.67	84,949.67
负债总计	-	-	-	347,289.45	347,289.45
利率敏感度缺口	3,142,244.02	-	-	36,706,259.88	39,848,503.90

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

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的	
		影响金额（单位：人民币元）	
		本期末	上年度末
		2026 年 6 月 30 日	2025 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	-1,909.76	-1,298.76
	市场利率下降 25 个基点	1,917.57	1,302.86

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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票及存托凭证投资比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股和备选成份股的资产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，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		上年度末	
	2026 年 6 月 30 日		2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产	公允价值	占基金资产

		净值比例 (%)		净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	32,883,402.35	89.07	36,975,135.10	92.79
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	32,883,402.35	89.07	36,975,135.10	92.79

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%	1,969,202.59	2,229,942.60
	2.业绩比较基准下降 5%	-1,969,202.59	-2,229,942.60

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	32,873,292.35	36,975,135.10
第二层次	1,929,477.59	1,919,289.10
第三层次	-	-
合计	34,802,769.94	38,894,424.20

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，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2025 年 12 月 31 日：同)。

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，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§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	32,883,402.35	88.55
	其中：股票	32,883,402.35	88.55
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	1,919,367.59	5.17
	其中：债券	1,919,367.59	5.17
	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	2,021,211.68	5.44
8	其他各项资产	311,813.31	0.84
9	合计	37,135,794.93	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末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	784,032.00	2.12
C	制造业	26,047,009.95	70.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	293,866.00	0.80
E	建筑业	300,601.00	0.81
F	批发和零售业	883,127.00	2.39
G	交通运输、仓储和邮政业	256,476.00	0.69
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,671,807.20	7.24
J	金融业	555,758.00	1.51
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	27,520.00	0.07
M	科学研究和技术服务业	526,138.20	1.43
N	水利、环境和公共设施管理业	401,335.00	1.09
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	135,732.00	0.37
S	综合	-	-
	合计	32,883,402.35	89.07

7.2.2 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

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	300857	协创数据	1,960	666,204.00	1.80
2	001309	德明利	600	565,740.00	1.53
3	300475	香农芯创	1,800	540,000.00	1.46
4	688347	华虹宏力	1,500	504,450.00	1.37
5	300604	长川科技	1,400	477,988.00	1.29
6	300223	北京君正	1,800	448,020.00	1.21
7	688498	源杰科技	200	377,200.00	1.02
8	688469	芯联集成	35,400	375,594.00	1.02
9	300458	全志科技	9,380	370,134.80	1.00
10	002281	光迅科技	1,400	359,716.00	0.97
11	688266	泽璟制药	2,900	338,314.00	0.92
12	688387	信科移动	17,000	337,280.00	0.91
13	301536	星宸科技	2,600	334,646.00	0.91
14	688002	睿创微纳	2,100	324,849.00	0.88
15	688385	复旦微电	4,500	320,805.00	0.87
16	002008	大族激光	2,100	315,231.00	0.85
17	002266	浙富控股	60,000	303,600.00	0.82
18	300073	当升科技	6,000	288,240.00	0.78
19	300136	信维通信	2,400	286,200.00	0.78
20	600499	科达制造	20,600	284,280.00	0.77
21	688120	华海清科	880	283,518.40	0.77
22	601869	长飞光纤	500	272,950.00	0.74
23	600601	方正科技	19,700	272,648.00	0.74
24	300919	中伟新材	6,100	266,875.00	0.72
25	002273	水晶光电	7,400	262,552.00	0.71
26	002841	视源股份	7,600	262,428.00	0.71
27	688220	翱捷科技	2,100	261,072.00	0.71
28	603806	福斯特	15,000	251,850.00	0.68
29	002738	中矿资源	4,200	247,758.00	0.67

30	300373	扬杰科技	1,500	235,845.00	0.64
31	002851	麦格米特	1,400	234,052.00	0.63
32	300054	鼎龙股份	2,200	233,134.00	0.63
33	688166	博瑞医药	6,600	231,066.00	0.63
34	603308	应流股份	3,800	229,520.00	0.62
35	600497	驰宏锌锗	18,700	226,457.00	0.61
36	002414	高德红外	16,400	217,464.00	0.59
37	601608	中信重工	42,600	203,202.00	0.55
38	688027	国盾量子	400	201,604.00	0.55
39	600316	洪都航空	7,200	201,168.00	0.54
40	600312	平高电气	11,100	196,026.00	0.53
41	688702	盛科通信	500	194,995.00	0.53
42	003022	联泓新科	7,400	191,660.00	0.52
43	300454	深信服	1,900	182,780.00	0.50
44	688728	格科微	8,600	180,944.00	0.49
45	000893	亚钾国际	4,400	179,916.00	0.49
46	600988	赤峰黄金	6,700	176,344.00	0.48
47	688361	中科飞测	400	172,000.00	0.47
48	300623	捷捷微电	3,800	170,962.00	0.46
49	300432	富临精工	8,500	170,765.00	0.46
50	600498	烽火通信	2,300	169,280.00	0.46
51	000423	东阿阿胶	3,700	167,832.00	0.45
52	300548	长芯博创	600	166,800.00	0.45
53	600535	天士力	12,500	165,375.00	0.45
54	000034	神州数码	5,900	163,725.00	0.44
55	003031	中瓷电子	900	162,270.00	0.44
56	002821	凯莱英	1,000	162,000.00	0.44
57	688018	乐鑫科技	1,260	161,179.20	0.44
58	300496	中科创达	2,600	160,654.00	0.44
59	688213	思特威	1,500	160,605.00	0.44
60	300037	新宙邦	1,700	157,845.00	0.43
61	688301	奕瑞科技	1,240	153,760.00	0.42
62	002195	岩山科技	23,500	153,690.00	0.42
63	603659	璞泰来	5,300	153,329.00	0.42
64	603379	三美股份	2,000	151,780.00	0.41
65	600141	兴发集团	3,200	150,304.00	0.41
66	002517	恺英网络	9,200	149,500.00	0.40
67	688313	仕佳光子	800	147,720.00	0.40
68	002756	永兴材料	2,600	147,264.00	0.40
69	002402	和而泰	5,700	147,231.00	0.40
70	300285	国瓷材料	1,400	144,452.00	0.39
71	603444	吉比特	400	143,368.00	0.39
72	300142	沃森生物	11,000	142,890.00	0.39
73	688568	中科星图	3,400	140,998.00	0.38

74	300390	天华新能	1,500	140,265.00	0.38
75	688234	天岳先进	800	138,808.00	0.38
76	601233	桐昆股份	6,400	138,560.00	0.38
77	688248	南网科技	2,000	138,360.00	0.37
78	002025	航天电器	1,800	137,196.00	0.37
79	688615	合合信息	1,200	135,720.00	0.37
80	600380	健康元	14,400	135,648.00	0.37
81	600595	中孚实业	24,100	135,442.00	0.37
82	000629	钒钛股份	40,300	134,602.00	0.36
83	002465	海格通信	10,500	134,085.00	0.36
84	600711	盛屯矿业	12,200	133,834.00	0.36
85	688099	晶晨股份	1,300	133,770.00	0.36
86	002155	湖南黄金	5,500	131,285.00	0.36
87	603298	杭叉集团	5,500	131,230.00	0.36
88	601615	明阳智能	11,300	130,741.00	0.35
89	300759	康龙化成	4,500	130,185.00	0.35
90	603225	新凤鸣	6,600	129,690.00	0.35
91	600105	永鼎股份	1,900	128,212.00	0.35
92	603129	春风动力	500	127,900.00	0.35
93	002487	大金重工	2,200	127,534.00	0.35
94	000060	中金岭南	16,500	124,905.00	0.34
95	300017	网宿科技	9,500	123,595.00	0.33
96	300012	华测检测	8,900	123,354.00	0.33
97	002429	兆驰股份	11,700	121,563.00	0.33
98	002120	韵达股份	19,000	120,840.00	0.33
99	601212	白银有色	23,700	120,396.00	0.33
100	688475	萤石网络	4,400	120,340.00	0.33
101	603345	安井食品	1,500	120,285.00	0.33
102	600369	西南证券	29,900	120,198.00	0.33
103	002335	科华数据	2,795	118,647.75	0.32
104	300677	英科医疗	3,000	117,510.00	0.32
105	600166	福田汽车	39,800	115,818.00	0.31
106	000021	深科技	1,800	115,686.00	0.31
107	688318	财富趋势	1,600	114,096.00	0.31
108	002436	兴森科技	2,200	112,090.00	0.30
109	000739	普洛药业	6,700	111,622.00	0.30
110	000959	首钢股份	31,800	111,618.00	0.30
111	600968	海油发展	33,500	111,555.00	0.30
112	600688	上海石化	38,000	111,340.00	0.30
113	600390	五矿资本	24,400	111,264.00	0.30
114	601399	国机重装	31,700	110,950.00	0.30
115	300666	江丰电子	300	110,580.00	0.30
116	603338	浙江鼎力	2,600	110,500.00	0.30
117	600008	首创环保	40,500	110,160.00	0.30

118	300002	神州泰岳	14,100	110,121.00	0.30
119	688617	惠泰医疗	600	108,936.00	0.30
120	600295	鄂尔多斯	10,100	108,272.00	0.29
121	002926	华西证券	13,100	107,027.00	0.29
122	600685	中船防务	4,200	106,848.00	0.29
123	300724	捷佳伟创	1,500	105,900.00	0.29
124	300627	华测导航	3,700	105,080.00	0.28
125	603077	和邦生物	45,200	104,864.00	0.28
126	000683	博源化工	17,800	102,528.00	0.28
127	002065	东华软件	14,100	100,674.00	0.27
128	603979	金诚信	1,700	100,351.00	0.27
129	000878	云南铜业	6,300	100,044.00	0.27
130	001287	中电港	3,200	99,680.00	0.27
131	002444	巨星科技	3,200	99,520.00	0.27
132	600816	建元信托	40,600	99,064.00	0.27
133	002262	恩华药业	5,200	97,500.00	0.26
134	000032	深桑达 A	3,900	97,305.00	0.26
135	600808	马钢股份	38,900	97,250.00	0.26
136	001389	广合科技	400	94,900.00	0.26
137	601226	华电科工	14,900	94,764.00	0.26
138	300877	金春股份	3,100	93,806.00	0.25
139	600879	航天电子	4,400	93,676.00	0.25
140	300395	菲利华	700	93,611.00	0.25
141	301526	国际复材	2,000	93,340.00	0.25
142	600765	中航重机	7,200	93,024.00	0.25
143	688563	航材股份	1,800	92,214.00	0.25
144	603290	斯达半导	600	91,764.00	0.25
145	601611	中国核建	8,200	91,430.00	0.25
146	601019	山东出版	14,100	90,240.00	0.24
147	688618	三旺通信	2,900	89,233.00	0.24
148	600871	石化油服	43,800	88,914.00	0.24
149	688037	芯源微	200	87,810.00	0.24
150	600131	国网信通	6,000	87,600.00	0.24
151	002624	完美世界	7,000	86,940.00	0.24
152	688052	纳芯微	300	86,493.00	0.23
153	601139	深圳燃气	15,200	86,032.00	0.23
154	301358	湖南裕能	1,100	83,457.00	0.23
154	002531	天顺风能	9,900	83,457.00	0.23
155	300346	南大光电	900	83,385.00	0.23
156	000559	万向钱潮	6,400	82,752.00	0.22
157	002064	华峰化学	8,700	82,563.00	0.22
158	600699	均胜电子	3,800	82,118.00	0.22
159	688778	厦钨新能	1,500	81,600.00	0.22
160	688281	华秦科技	1,600	80,368.00	0.22

161	002185	华天科技	3,600	80,316.00	0.22
162	002558	巨人网络	2,900	79,924.00	0.22
163	002394	联发股份	8,900	79,388.00	0.22
164	002202	金风科技	3,300	78,870.00	0.21
165	300658	延江股份	6,900	78,867.00	0.21
166	300003	乐普医疗	6,600	78,210.00	0.21
167	600884	杉杉股份	5,700	77,235.00	0.21
168	300339	润和软件	2,000	77,020.00	0.21
169	605389	长龄液压	800	76,800.00	0.21
170	600970	中材国际	10,600	75,578.00	0.20
171	688180	君实生物	2,200	74,404.00	0.20
172	000932	华菱钢铁	21,400	74,258.00	0.20
173	688375	国博电子	700	73,010.00	0.20
174	001326	联域股份	1,200	71,148.00	0.19
175	300487	蓝晓科技	1,200	70,620.00	0.19
176	603699	纽威股份	1,400	70,420.00	0.19
177	301308	江波龙	100	70,380.00	0.19
178	301186	超达装备	1,700	69,700.00	0.19
179	301181	标榜股份	3,000	69,420.00	0.19
180	002396	星网锐捷	3,600	69,012.00	0.19
181	600885	宏发股份	2,000	68,980.00	0.19
182	601106	中国一重	20,700	68,310.00	0.19
183	600562	国睿科技	3,200	67,904.00	0.18
184	603926	铁流股份	3,700	65,453.00	0.18
185	605222	起帆电缆	2,800	65,296.00	0.18
186	600927	永安期货	5,200	64,740.00	0.18
187	300590	移为通信	4,500	64,575.00	0.17
188	002283	天润工业	6,600	63,690.00	0.17
189	300913	兆龙互连	1,300	62,283.00	0.17
190	300757	罗博特科	100	61,900.00	0.17
191	002130	沃尔核材	3,200	60,672.00	0.16
192	002752	昇兴股份	10,900	60,168.00	0.16
193	603092	德力佳	1,100	59,367.00	0.16
194	600292	电投水电	4,900	58,996.00	0.16
195	300115	长盈精密	2,100	58,674.00	0.16
196	605189	富春染织	4,800	57,840.00	0.16
197	603786	科博达	1,400	57,274.00	0.16
198	300201	海伦哲	2,700	56,889.00	0.15
199	601000	唐山港	13,100	54,365.00	0.15
200	600299	安迪苏	6,900	54,165.00	0.15
201	002384	东山精密	200	52,470.00	0.14
202	300580	贝斯特	2,500	50,275.00	0.14
203	000703	恒逸石化	3,700	50,209.00	0.14
204	001286	陕西能源	4,900	49,686.00	0.13

205	600517	国网英大	10,400	48,672.00	0.13
206	605365	立达信	3,300	47,454.00	0.13
207	688777	中控技术	400	47,000.00	0.13
208	000528	柳工	6,200	46,810.00	0.13
209	603085	天成自控	4,300	46,741.00	0.13
210	603111	康尼机电	8,200	46,412.00	0.13
211	601179	中国西电	3,100	46,252.00	0.13
212	603096	新经典	3,400	45,492.00	0.12
213	603233	大参林	3,000	45,090.00	0.12
214	000582	北部湾港	4,100	43,993.00	0.12
215	002942	新农股份	3,000	42,990.00	0.12
216	300699	光威复材	1,500	42,975.00	0.12
217	002838	道恩股份	1,400	42,868.00	0.12
218	301032	新柴股份	4,600	42,780.00	0.12
219	002521	齐峰新材	5,900	42,716.00	0.12
220	301559	中集环科	3,500	42,665.00	0.12
221	600398	海澜之家	8,100	42,363.00	0.11
222	000039	中集集团	5,200	42,172.00	0.11
223	600583	海油工程	8,300	41,749.00	0.11
224	603577	汇金通	4,300	40,506.00	0.11
225	002716	湖南白银	5,000	40,450.00	0.11
226	603018	华设集团	7,680	39,475.20	0.11
227	600177	雅戈尔	5,200	39,156.00	0.11
228	000726	鲁泰 A	7,200	39,096.00	0.11
229	002391	长青股份	8,000	38,960.00	0.11
230	002887	绿茵生态	3,700	38,739.00	0.10
231	002379	宏桥控股	2,600	38,402.00	0.10
232	600332	白云山	1,900	38,076.00	0.10
233	000598	兴蓉环境	5,900	37,878.00	0.10
234	300620	光库科技	100	37,820.00	0.10
235	002381	双箭股份	7,300	37,814.00	0.10
236	603606	东方电缆	900	37,359.00	0.10
237	603565	中谷物流	3,800	37,278.00	0.10
238	000850	华茂股份	10,600	37,206.00	0.10
239	600817	宇通重工	4,200	36,960.00	0.10
240	600987	航民股份	6,100	36,905.00	0.10
241	600218	全柴动力	5,100	36,822.00	0.10
242	002666	德联集团	9,300	36,735.00	0.10
243	002722	物产金轮	3,100	36,549.00	0.10
244	603238	诺邦股份	3,300	36,300.00	0.10
245	601068	中铝国际	8,400	36,288.00	0.10
246	000529	广弘控股	8,500	36,210.00	0.10
247	603700	宁水集团	3,100	35,991.00	0.10
248	603408	建霖家居	3,700	35,705.00	0.10

249	600262	北方股份	1,800	35,622.00	0.10
250	600566	济川药业	1,600	35,504.00	0.10
251	605001	威奥股份	6,500	35,425.00	0.10
252	002376	新北洋	6,100	35,075.00	0.10
253	600335	国机汽车	7,400	34,632.00	0.09
254	300512	中亚股份	4,800	32,736.00	0.09
255	300567	精测电子	100	31,760.00	0.09
256	603273	天元智能	2,200	28,490.00	0.08
257	300751	迈为股份	100	28,246.00	0.08
258	300058	蓝色光标	2,000	27,520.00	0.07
259	603256	宏和科技	100	26,533.00	0.07
260	002407	多氟多	500	25,115.00	0.07
261	301208	中亦科技	800	22,792.00	0.06
262	002409	雅克科技	100	22,450.00	0.06
263	002138	顺络电子	300	21,930.00	0.06
264	002835	同为股份	1,800	20,646.00	0.06
265	605589	圣泉集团	300	19,071.00	0.05
266	600845	宝信软件	1,100	18,293.00	0.05
267	688172	燕东微	200	16,732.00	0.05
268	002126	银轮股份	300	14,940.00	0.04
269	600392	盛和资源	500	14,885.00	0.04
270	301082	久盛电气	1,600	14,336.00	0.04
271	002340	格林美	1,700	11,237.00	0.03
272	001248	华润新能源	1,000	10,110.00	0.03
273	300207	欣旺达	500	9,495.00	0.03
274	600901	江苏金租	600	3,450.00	0.01
275	688428	诺诚健华	100	2,847.00	0.01
276	002945	华林证券	100	1,343.00	0.00
277	002007	华兰生物	100	1,219.00	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	688347	华虹宏力	1,170,025.37	2.94
2	688525	佰维存储	1,151,653.76	2.89
3	002532	天山铝业	959,338.00	2.41
4	300037	新宙邦	919,734.00	2.31
5	688002	睿创微纳	913,618.37	2.29
6	300604	长川科技	906,955.00	2.28

7	002281	光迅科技	883,031.00	2.22
8	000933	神火股份	860,208.00	2.16
9	688166	博瑞医药	857,009.15	2.15
10	000932	华菱钢铁	854,330.00	2.14
11	002738	中矿资源	850,902.20	2.14
12	688120	华海清科	833,220.52	2.09
13	688778	厦钨新能	791,898.52	1.99
14	688027	国盾量子	790,783.00	1.98
15	300207	欣旺达	790,340.00	1.98
16	000060	中金岭南	778,310.00	1.95
17	300003	乐普医疗	773,440.00	1.94
18	600487	亨通光电	755,897.00	1.90
19	688037	芯源微	732,580.42	1.84
20	000528	柳工	732,019.00	1.84

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	688525	佰维存储	1,497,055.65	3.76
2	600487	亨通光电	1,153,306.00	2.89
3	002156	通富微电	1,095,255.00	2.75
4	300373	扬杰科技	1,043,598.00	2.62
5	600549	厦门钨业	978,678.00	2.46
6	300207	欣旺达	974,526.00	2.45
7	300604	长川科技	953,680.00	2.39
8	300003	乐普医疗	952,848.00	2.39
9	688347	华虹宏力	947,023.59	2.38
10	601168	西部矿业	940,851.00	2.36
11	002532	天山铝业	937,770.00	2.35
12	600528	中铁工业	934,533.00	2.35
13	000933	神火股份	926,130.00	2.32
14	002008	大族激光	916,624.00	2.30
15	002624	完美世界	904,841.00	2.27
16	300037	新宙邦	895,781.00	2.25
17	601958	金钼股份	894,686.00	2.25
18	300857	协创数据	888,348.00	2.23
19	605589	圣泉集团	879,392.00	2.21
20	300012	华测检测	838,451.00	2.10
21	600497	驰宏锌锗	838,175.00	2.10

22	301308	江波龙	833,229.00	2.09
23	603659	璞泰来	827,827.00	2.08
24	300070	碧水源	820,609.00	2.06
25	601865	福莱特	810,724.00	2.03

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

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	172,977,677.88
卖出股票的收入（成交）总额	183,272,691.83

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	1,919,367.59	5.20
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,919,367.59	5.20

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净
----	------	------	-------	------	--------

					值比例(%)
1	019771	25 国债 06	10,000	1,008,004.66	2.73
2	019785	25 国债 13	8,000	810,100.38	2.19
3	102310	国债 2513	1,000	101,262.55	0.27

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

本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，以套期保值为目的，本着谨慎原则，参与股指期货的投资。本基金投资股指期货将主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，并根据对证券市场和期货市场运行趋势的研判，以及对股指期货合约的估值定价，与股票现货资产进行匹配，实现多头或空头的套期保值操作，以对冲风险资产组合的系统性风险和流动性风险。并利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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

7.11.2 本期国债期货投资评价

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 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

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	222,484.66
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	57,094.36
6	其他应收款	32,234.29
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	311,813.31

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份	持有份额	占总份

				额比例		额比例
海富通中证 500 增强 A	1,718	6,453.49	50,299.94	0.45%	11,036,801.19	99.55%
海富通中证 500 增强 C	1,257	2,478.06	-	-	3,114,925.72	100.00%
合计	2,975	4,773.79	50,299.94	0.35%	14,151,726.91	99.65%

注：本表基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，A、C 级比例分母为各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	海富通中证 500 增强 A	78,496.49	0.7080%
	海富通中证 500 增强 C	39,457.00	1.2667%
	合计	117,953.49	0.8305%

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	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	海富通中证 500 增强 A	0~10
	海富通中证 500 增强 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通中证 500 增强 A	0~10
	海富通中证 500 增强 C	0~10
	合计	0~10

8.9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通中证 500 增强 A	海富通中证 500 增强 C
基金合同生效日（2020 年 3 月 5 日）基金份额总额	17,367,521.34	-
本报告期期初基金份额总额	13,581,255.49	4,481,443.46
本报告期基金总申购份额	1,804,118.55	4,277,594.56
减：本报告期基金总赎回份额	4,298,272.91	5,644,112.30
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	11,087,101.13	3,114,925.72

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§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

报告期内，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

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	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股	佣金	占当期佣	

	数量		票成交总 额的比例		金总量的 比例	
国泰海通证券	4	311,634,005.14	87.48%	57,933.89	87.48%	-
华泰证券	1	44,601,194.57	12.52%	8,291.11	12.52%	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

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
国泰海通证券	2,305,465.00	100.00%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

银河证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

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
2	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东莞证券股份有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	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	2026-04-20
3	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
4	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增易方达财富管理基金销售（广州）有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	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	2026-05-13
5	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
6	海富通基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	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	2026-06-10
7	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

§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
个人	1	2026/1/1-2026/4/7, 2026/5/22-2026/6/	4,373,492.58	-	1,457,830.86	2,915,661.72	20.53%

		30					
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。 另外，当某单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。							

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)中国证监会准予海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金变更注册的文件
- (二)海富通中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同
- (三)海富通中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书
- (四)海富通中证 500 指数增强型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它文件

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