

海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金

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

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	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18
6.3 净资产变动表	20
6.4 报表附注	21
§7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	63
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	64
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	64
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	64
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	64
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	64
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	64
7.12 投资组合报告附注	65
§8 基金份额持有人信息	65

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	66
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	66
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	66
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	67
§9 开放式基金份额变动	67
§10 重大事件揭示	67
10.1 基金份额持有人大会决议	67
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	67
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	68
10.4 基金投资策略的改变	68
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	68
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	68
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	68
10.8 其他重大事件	69
11 影响投资者决策的其他重要信息	70
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	70
§12 备查文件目录	70
12.1 备查文件目录	70
12.2 存放地点	71
12.3 查阅方式	71

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	海富通中证 A500 指数增强	
基金主代码	023367	
基金运作方式	契约型开放式、发起式	
基金合同生效日	2025 年 3 月 25 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	392,968,317.13 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 A500 指数增强 A	海富通中证 A500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	023367	023368
报告期末下属分级基金的份额总额	249,544,547.59 份	143,423,769.54 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，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。
投资策略	1、股票投资策略 （1）标的指数：本基金股票资产跟踪的标的指数为中证 A500 指数。 （2）量化增强策略 本基金一方面采用指数化被动投资策略以追求有效跟踪标的指数，避免大幅偏离标的指数；另一方面采用量化模型调整投资组合，力求实现高于标的指数的投资收益。本基金运用的量化投资模型借鉴国际一流定量分析的应用经验，利用多因子 alpha 模型预测股票超额回报，在有效风险控制及交易成本最低化的基础上优化投资组合。主要包括多因子 alpha 模型——股票超额回报预测、风险估测模型——有效控制风险预算、交易成本模型——控制成本并保护业绩和投资组合优化模型。 2、债券投资策略；3、可转换债券和可交换债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、股指期货投资策略；6、国债期货投资策略；7、股票期权投资策略；8、融资及转融通证券出借策略；9、存托凭证投资策略。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。同时，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		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	《上海证券报》
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	海富通基金管理有限公司	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

§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 A500 指数增强 A	海富通中证 A500 指数增强 C
本期已实现收益	24,074,542.74	8,611,560.81
本期利润	39,862,118.65	16,670,335.75
加权平均基金份额本期利润	0.1794	0.1736
本期加权平均净值利润率	13.59%	13.17%
本期基金份额净值增长率	13.92%	13.69%
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 A500 指数增强 A	海富通中证 A500 指数增强 C
期末可供分配利润	94,204,113.80	53,146,053.84
期末可供分配基金份额利润	0.3775	0.3706
期末基金资产净值	350,502,058.25	200,435,666.78
期末基金份额净值	1.4046	1.3975
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	海富通中证 A500 指数增强 A	海富通中证 A500 指数增强 C
基金份额累计净值增长率	40.46%	39.75%

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 A500 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	13.27%	1.43%	13.54%	1.34%	-0.27%	0.09%
过去六个月	13.92%	1.32%	11.34%	1.22%	2.58%	0.10%
过去一年	35.34%	1.11%	34.41%	1.09%	0.93%	0.02%
自基金合同生	40.46%	1.01%	33.58%	1.09%	6.88%	-0.08%

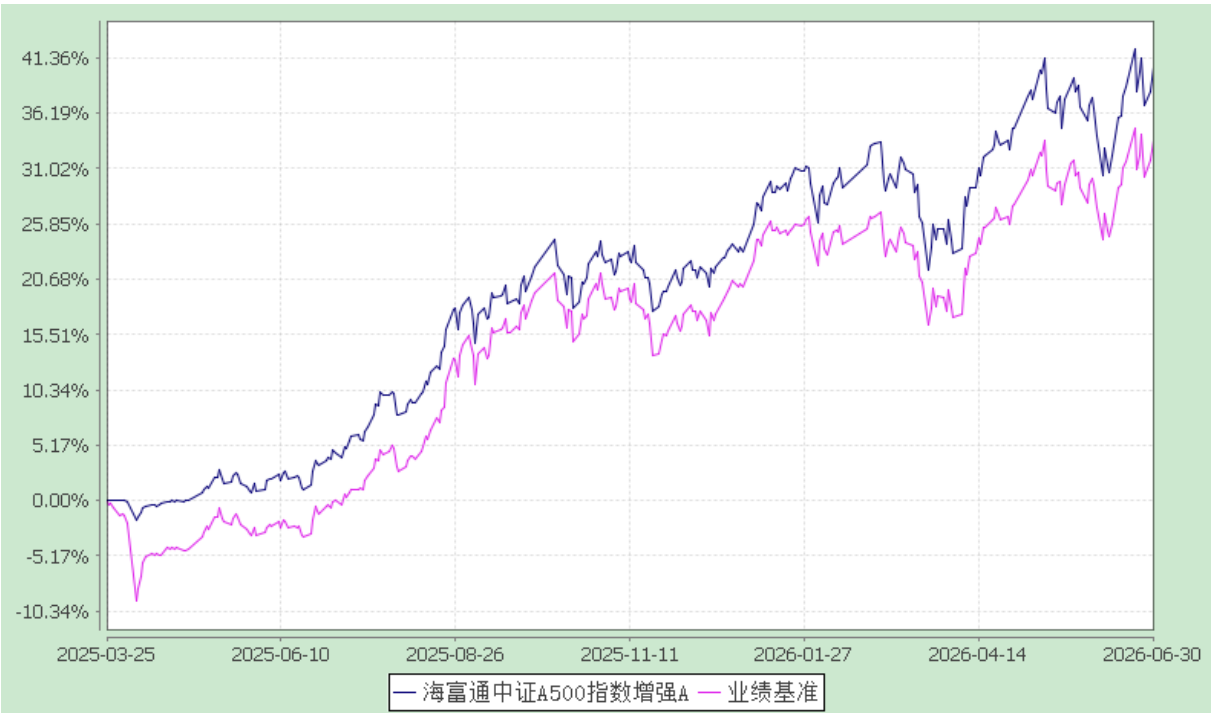
效起至今						
海富通中证 A500 指数增强 C						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	13.15%	1.43%	13.54%	1.34%	-0.39%	0.09%
过去六个月	13.69%	1.32%	11.34%	1.22%	2.35%	0.10%
过去一年	34.80%	1.11%	34.41%	1.09%	0.39%	0.02%
自基金合同生效起至今	39.75%	1.01%	33.58%	1.09%	6.17%	-0.08%

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

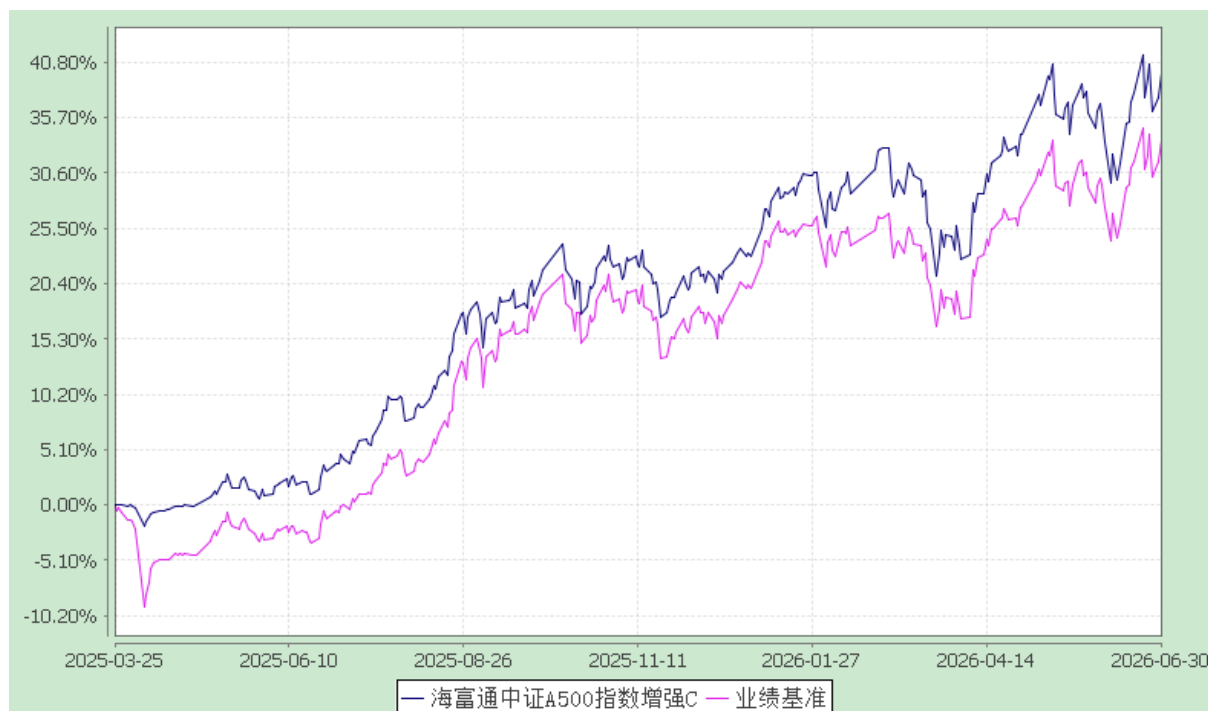
海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金

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 3 月 25 日至 2026 年 6 月 30 日)

海富通中证 A500 指数增强 A



海富通中证 A500 指数增强 C



注：本基金合同于 2025 年 3 月 25 日生效，按基金合同约定，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		
朱斌全	本基金的基金经理	2025-03-25	-	19 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。2005 年 7 月至 2006 年 8 月任上海涅柔斯投资管理有限公司美股交易员。2007 年 4 月加入海富通基金管理有限公司，历任交易员、高级交易员、量化分析师、投资经理、基金经理助理。2018 年 11 月至 2022 年 8 月任海富通阿尔法对冲混合基金经理。2019 年 10 月至 2022 年 12 月兼任海富通富祥混合基金经理。2019 年 10 月起兼任海富通沪深 300 增强(原海富通富睿混合)、海富通欣益混合的基金经理。2019 年 10 月至 2025 年 5 月兼任海富通量化多因子混合基金经理。2020 年 10 月至 2025 年 8 月兼任海富通欣享混合的基金经理。2020 年 10 月至 2022 年 8 月兼任海富通新内需混合基金经理。2022 年 8 月起兼任海富通安益对冲混合基金经理。2022 年 12 月至 2024 年 4 月兼任海富通量化前锋股票、海富通中证 500 增强基金经理。2024 年 3 月至 2025 年 6 月兼任海富通中证 2000 增强策略 ETF 基金经理。2025 年 3 月起兼任海

					富通中证 A500 指数增强基金经理。
李自悟	本基金的基金经理；量化投资部副总监（主持工作）。	2025-12-25	-	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基金经理。2023 年 4 月起兼任海富通阿尔法对冲混合基金经理。2024 年 3 月起兼任海富通中证 2000 增强策略 ETF 基金经理。2024 年 7 月起兼任海富通量化选股混合基金经理。2025 年 3 月起兼任海富通欣益混合基金经理。2025 年 12 月起兼任海富通中证 A500 指数增强基金经理。2026 年 5 月起兼任海富通沪深 300 指数增强基金经理。
林立禾	本基金的基金经理	2025-03-25	-	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 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

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 A500 指数增强 A 净值增长率为 13.92%，同期业绩比较基准收益率为 11.34%。海富通中证 A500 指数增强 C 净值增长率为 13.69%，同期业绩比较基准收益率为 11.34%。

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

根据本基金合同规定，基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的某一类基金份额净值减去该类份额每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

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合规守信情况声明

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 指数增强型发起式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合规守信、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 指数增强型发起式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 指数增强型发起式证券投资基金

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	21,991,781.74	12,970,781.79
结算备付金		8,000,568.73	1,190,964.76
存出保证金		1,073,630.14	1,257,720.69
交易性金融资产	6.4.7.2	521,617,328.50	145,640,709.61
其中：股票投资		507,382,570.05	143,728,845.72
基金投资		-	-
债券投资		14,234,758.45	1,911,863.89
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		5,625,661.51	915,899.91
应收股利		-	-
应收申购款		1,906,991.83	9,853,145.04
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		560,215,962.45	171,829,221.80
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		5,875,680.56	6,338,162.27
应付赎回款		2,423,811.92	689,509.36
应付管理人报酬		359,036.81	73,585.67
应付托管费		44,879.59	9,198.22
应付销售服务费		65,669.96	8,628.88
应付投资顾问费		-	-
应交税费		15,819.87	4,980.05
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	493,338.71	181,669.54
负债合计		9,278,237.42	7,305,733.99
净资产:			
实收基金	6.4.7.7	392,968,317.13	133,551,331.35
未分配利润	6.4.7.8	157,969,407.90	30,972,156.46
净资产合计		550,937,725.03	164,523,487.81
负债和净资产总计		560,215,962.45	171,829,221.80

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.4046 元，C 类基金份额净值 1.3975 元。基金份额总额 392,968,317.13 份，其中 A 类基金份额 249,544,547.59 份，C 类基金份额 143,423,769.54 份。

6.2 利润表

会计主体：海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金

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 3 月 25 日（基 金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		58,716,522.70	6,809,795.49
1.利息收入		60,674.93	278,207.09
其中：存款利息收入	6.4.7.9	56,811.69	130,025.64
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,863.24	148,181.45
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		34,609,040.85	4,729,023.35
其中：股票投资收益	6.4.7.10	29,392,532.62	1,615,543.48
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	69,096.99	29,978.04
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	1,233,432.93	1,653,118.54
股利收益	6.4.7.14	3,913,978.31	1,430,383.29
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	23,846,350.85	1,801,483.31
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	200,456.07	1,081.74
减：二、营业总支出		2,184,068.30	546,479.61
1. 管理人报酬		1,649,635.00	380,012.11
2. 托管费		206,204.33	47,501.53
3. 销售服务费		247,528.03	59,267.43
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		4,601.80	6,493.94
8. 其他费用	6.4.7.17	76,099.14	53,204.60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		56,532,454.40	6,263,315.88
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		56,532,454.40	6,263,315.88
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		56,532,454.40	6,263,315.88

6.3 净资产变动表

会计主体：海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金

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	133,551,331.35	-	30,972,156.46	164,523,487.81
二、本期期初净资产	133,551,331.35	-	30,972,156.46	164,523,487.81
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	259,416,985.78	-	126,997,251.44	386,414,237.22
（一）、综合收益总额	-	-	56,532,454.40	56,532,454.40
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	259,416,985.78	-	70,464,797.04	329,881,782.82
其中：1.基金申购款	797,941,885.56	-	254,507,789.94	1,052,449,675.50
2.基金赎回款	-538,524,899.78	-	-184,042,992.90	-722,567,892.68
（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	392,968,317.13	-	157,969,407.90	550,937,725.03
项目	上年度可比期间 2025 年 3 月 25 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	232,661,339.38	-	-	232,661,339.38

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-119,375,487.15	-	4,262,442.02	-115,113,045.13
（一）、综合收益总额	-	-	6,263,315.88	6,263,315.88
（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）	-119,375,487.15	-	-2,000,873.86	-121,376,361.01
其中：1.基金申购款	24,655,853.07	-	551,151.43	25,207,004.50
2.基金赎回款	-144,031,340.22	-	-2,552,025.29	-146,583,365.51
（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	113,285,852.23	-	4,262,442.02	117,548,294.25

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 指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2025]44 号《关于准予海富通中证 A500 指数增强型发起式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法》和《海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约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 232,598,348.48 元。经向中国证监会备案，《海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于 2025 年 3 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 232,661,339.38 份，其中认购资金利息折合基金份额 62,990.90 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《海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》和《海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用及销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购基金时收取认购/申购费用，而不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购基金份额时不收取认购/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通中证 A500 指数增强型发起式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具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股、备选成份股、其他国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、科创板及其他中国证监会核准或注册上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、可交换债券及其他中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金可根据相关法律法规的规定，参与融资和转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为：本基金持有的股票资产及存托凭证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（含存托凭证）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、国债期货合约和股票期权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。本基金的业绩比较基准为：中证 A500 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人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	21,991,781.74
等于：本金	21,989,052.09
加：应计利息	2,729.65
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	21,991,781.74

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		481,218,650.05	-	507,382,570.05	26,163,920.00
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	14,102,519.53	126,238.45	14,234,758.45	6,000.47
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	14,102,519.53	126,238.45	14,234,758.45	6,000.47
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		495,321,169.58	126,238.45	521,617,328.50	26,169,920.47

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	5,908,580.00	-	-	-
——股指期货	5,908,580.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	5,908,580.00	-	-	-

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
IF2609	IF2609	3.00	4,364,820.00	60,060.00
IC2609	IC2609	1.00	1,752,280.00	148,460.00
合计	-	-	-	208,520.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	208,520.00
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从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末其他资产无余额。

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	421,434.65
其中：交易所市场	421,434.65
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	71,904.06
合计	493,338.71

6.4.7.7 实收基金

海富通中证 A500 指数增强 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	95,545,001.24	95,545,001.24
本期申购	470,620,545.28	470,620,545.28
本期赎回（以“-”号填列）	-316,620,998.93	-316,620,998.93
本期末	249,544,547.59	249,544,547.59

海富通中证 A500 指数增强 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	38,006,330.11	38,006,330.11
本期申购	327,321,340.28	327,321,340.28
本期赎回（以“-”号填列）	-221,903,900.85	-221,903,900.85
本期末	143,423,769.54	143,423,769.54

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 A500 指数增强 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	21,768,674.15	492,624.26	22,261,298.41
本期期初	21,768,674.15	492,624.26	22,261,298.41
本期利润	24,074,542.74	15,787,575.91	39,862,118.65
本期基金份额交易产生的变动数	48,360,896.91	-9,526,803.31	38,834,093.60
其中：基金申购款	148,502,255.58	774,743.97	149,276,999.55
基金赎回款	-100,141,358.67	-10,301,547.28	-110,442,905.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	94,204,113.80	6,753,396.86	100,957,510.66

海富通中证 A500 指数增强 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	8,514,632.95	196,225.10	8,710,858.05
本期期初	8,514,632.95	196,225.10	8,710,858.05
本期利润	8,611,560.81	8,058,774.94	16,670,335.75
本期基金份额交易产生的变动数	36,019,860.08	-4,389,156.64	31,630,703.44
其中：基金申购款	105,642,976.03	-412,185.64	105,230,790.39
基金赎回款	-69,623,115.95	-3,976,971.00	-73,600,086.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	53,146,053.84	3,865,843.40	57,011,897.24

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	42,386.78
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	13,631.06
其他	793.85
合计	56,811.69

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	1,705,384,003.80
减：卖出股票成本总额	1,674,209,185.86
减：交易费用	1,782,285.32
买卖股票差价收入	29,392,532.62

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	68,253.19
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	843.80
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	69,096.99

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	1,814,302.81
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,800,567.20
减：应计利息总额	12,891.81
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	843.80

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）	1,274,496.67
减：股指期货差价收入应缴纳增值税额	37,121.26
减：交易费用	3,942.48
合计	1,233,432.93

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	3,913,978.31
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	3,913,978.31

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	23,690,447.52
——股票投资	23,684,237.32
——债券投资	6,210.20
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	155,903.33
——权证投资	-
——股指期货	155,903.33
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	23,846,350.85

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	200,454.82
基金转换费收入	1.25
合计	200,456.07

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	12,396.69
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	4,195.08
合计	76,099.14

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

截至本财务报表批准报出日，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、注册登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司(“浦发银行”)	基金托管人、基金销售机构
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。

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3月25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	812,966,008.46	21.86%	410,462,684.73	100.00%
--------	----------------	--------	----------------	---------

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	151,130.63	21.87%	151,130.63	35.86%
关联方名称	上年度可比期间 2025年3月25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
国泰海通证券	76,297.44	100.00%	73,547.31	100.00%

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3月25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	1,649,635.00	380,012.11
其中：应支付销售机构的客户维护费	738,299.96	151,475.54
应支付基金管理人的净管理费	911,335.04	228,536.57

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3月25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	206,204.33	47,501.53

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 0.10% 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 x0.10%/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 A500 指数增强 A	海富通中证 A500 指数增强 C	合计
浦发银行	-	226,380.38	226,380.38
海富通	-	2,716.11	2,716.11
国泰海通证券	-	495.19	495.19
合计	-	229,591.68	229,591.68
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025年3月25日（基金合同生效日）至2025年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通中证A500指数增强A	海富通中证A500指数增强C	合计
浦发银行	-	44,636.84	44,636.84
国泰海通证券	-	39.16	39.16
合计	-	44,676.00	44,676.00

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 0.40%，基金销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.40% 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 x0.40%/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

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3月25日（基金合同生效日）至2025 年6月30日	
	海富通中证A500 指数增强A	海富通中证A500指 数增强C	海富通中证A500指 数增强A	海富通中证A500指 数增强C
基金合同生效日 （2025年3月25日） 持有的基金份额	-	-	10,002,083.54	-
报告期初持有的基 金份额	10,002,083.54	-	-	-
报告期间申购/买入 总份额	-	-	-	-
报告期间因拆分变 动份额	-	-	-	-
减：报告期间赎回/ 卖出总份额	-	-	-	-
报告期末持有的基 金份额	10,002,083.54	-	10,002,083.54	-
报告期末持有的基 金份额占基金总份 额比例	4.01%	-	10.85%	-

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

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 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年3月25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	21,991,781.74	42,386.78	177,399.97	23,296.94

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	301599	理奇智能	网下申购	4,325	60,160.75
国泰海通证 券	301696	三瑞智能	网下申购	2,157	53,234.76
国泰海通证 券	688635	长进光子	网下申购	1,271	52,085.58
上年度可比期间 2025 年 3 月 25 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

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
00123 7	惠康 科技	2026-0 5-15	6 个月	新股 锁定	53.26	58.74	233	12,409 .58	13,686 .42	-
00124 8	华润 新能 源	2026-0 6-24	1 个月 内 (含)	新股 未上 市	10.11	10.11	7,737	78,221 .07	78,221 .07	-
00124 8	华润 新能 源	2026-0 6-24	6 个月	新股 未上 市并 锁定	10.11	10.11	18,054	182,52 5.94	182,52 5.94	-
00125 7	盛龙 股份	2026-0 3-24	6 个月	新股 锁定	7.82	20.74	1,614	12,621 .48	33,474 .36	-

001312	福恩股份	2026-04-14	6 个月	新股锁定	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001365	天海电子	2026-05-11	6 个月	新股锁定	27.19	31.31	555	15,090.45	17,377.05	-
001393	维通利	2026-05-08	6 个月	新股锁定	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
001399	惠科股份	2026-06-16	6 个月	新股锁定	10.12	27.73	2,874	29,084.88	79,696.02	-
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	433	6,023.03	14,059.51	-
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	-
301680	固德电材	2026-02-27	6 个月	新股锁定	58.00	112.16	74	4,292.00	8,299.84	-
301683	慧谷新材	2026-03-24	6 个月	新股锁定	78.38	121.77	88	6,897.44	10,715.76	-
301696	三瑞智能	2026-03-31	6 个月	新股锁定	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
601112	振石股份	2026-01-21	6 个月	新股锁定	11.18	17.59	151	1,688.18	2,656.09	-
603284	林平发展	2026-02-03	6 个月	新股锁定	37.88	34.87	35	1,325.80	1,220.45	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6 个月	新股锁定	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
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	-
603435	嘉德利	2026-05-15	6 个月	新股锁定	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026-03-31	6 个月	新股锁定	17.70	84.32	272	4,814.40	22,935.04	-
688635	长进光子	2026-05-20	6 个月	新股锁定	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6 个月	新股锁定	17.52	35.92	733	12,842.16	26,329.36	-
688797	臻宝科技	2026-06-16	6 个月	新股锁定	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6 个月	新股锁定	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688816	易思维	2026-02-04	6 个月	新股锁定	55.95	57.10	71	3,972.45	4,054.10	-

688820	盛合晶微	2026-04-13	6 个月	新股锁定	19.68	141.49	598	11,768.64	84,611.02	-
--------	------	------------	------	------	-------	--------	-----	-----------	-----------	---

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	14,234,758.45	1,911,863.89
合计	14,234,758.45	1,911,863.89

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，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	21,991,781.74	-	-	-	21,991,781.74
结算备付金	8,000,568.73	-	-	-	8,000,568.73
存出保证金	339,578.14	-	-	734,052.00	1,073,630.14
交易性金融资产	14,234,758.45	-	-	507,382,570.05	521,617,328.50
应收清算款	-	-	-	5,625,661.51	5,625,661.51
应收申购款	-	-	-	1,906,991.83	1,906,991.83
资产总计	44,566,687.06	-	-	515,649,275.39	560,215,962.45
负债					
应付清算款	-	-	-	5,875,680.56	5,875,680.56
应付赎回款	-	-	-	2,423,811.92	2,423,811.92
应付管理人报酬	-	-	-	359,036.81	359,036.81
应付托管费	-	-	-	44,879.59	44,879.59
应付销售服务费	-	-	-	65,669.96	65,669.96
应交税费	-	-	-	15,819.87	15,819.87
其他负债	-	-	-	493,338.71	493,338.71
负债总计	-	-	-	9,278,237.42	9,278,237.42
利率敏感度缺口	44,566,687.06	-	-	506,371,037.97	550,937,725.03
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	12,970,781.79	-	-	-	12,970,781.79
结算备付金	1,190,964.76	-	-	-	1,190,964.76

存出保证金	42,036.69	-	-	1,215,684.00	1,257,720.69
交易性金融资产	1,911,863.89	-	-	143,728,845.72	145,640,709.61
应收清算款	-	-	-	915,899.91	915,899.91
应收申购款	-	-	-	9,853,145.04	9,853,145.04
资产总计	16,115,647.13	-	-	155,713,574.67	171,829,221.80
负债					
应付清算款	-	-	-	6,338,162.27	6,338,162.27
应付赎回款	-	-	-	689,509.36	689,509.36
应付管理人报酬	-	-	-	73,585.67	73,585.67
应付托管费	-	-	-	9,198.22	9,198.22
应付销售服务费	-	-	-	8,628.88	8,628.88
应交税费	-	-	-	4,980.05	4,980.05
其他负债	-	-	-	181,669.54	181,669.54
负债总计	-	-	-	7,305,733.99	7,305,733.99
利率敏感度缺口	16,115,647.13	-	-	148,407,840.68	164,523,487.81

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	-11,192.99	-2,590.39
	市场利率下降 25 个基点	11,233.33	2,600.32

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，本基金一方面采用指数化被动投资策略以追求有效跟踪标的指数，避免大幅偏离标的指数；另一方面采用量化模型调整投资组合，力求实现高于标的指数的投资收益。本基金运用的量化投资模型借鉴国际一流定量分析的应用经验，利用多因子 alpha 模型预测股票超额回报，在有效风险控制及交易成本最低化的基础上优化投资组合。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 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	507,382,570.05	92.09	143,728,845.72	87.36
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	507,382,570.05	92.09	143,728,845.72	87.36

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%	35,219,587.15	9,129,167.61
	2.业绩比较基准下降 5%	-35,219,587.15	-9,129,167.61

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	506,535,033.40	143,161,413.72
第二层次	14,495,505.46	2,479,295.89
第三层次	586,789.64	-
合计	521,617,328.50	145,640,709.61

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	507,382,570.05	90.57
	其中：股票	507,382,570.05	90.57
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	14,234,758.45	2.54
	其中：债券	14,234,758.45	2.54
	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	29,992,350.47	5.35
8	其他各项资产	8,606,283.48	1.54
9	合计	560,215,962.45	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

7.2.1.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

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	265,408.00	0.05
B	采矿业	27,508,113.00	4.99
C	制造业	316,775,688.50	57.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,495,938.00	0.63
E	建筑业	5,255,377.00	0.95

F	批发和零售业	9,064,628.00	1.65
G	交通运输、仓储和邮政业	8,475,934.00	1.54
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	38,883,799.20	7.06
J	金融业	23,420,185.00	4.25
K	房地产业	85,675.00	0.02
L	租赁和商务服务业	382,889.00	0.07
M	科学研究和技术服务业	5,387,424.00	0.98
N	水利、环境和公共设施管理业	2,004,617.00	0.36
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,818,646.00	0.33
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	1,930,850.00	0.35
	合计	444,755,171.70	80.73

7.2.1.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

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	33,474.36	0.01
C	制造业	46,946,192.00	8.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,195,832.01	0.58
E	建筑业	3,187,430.00	0.58
F	批发和零售业	2,398,402.00	0.44
G	交通运输、仓储和邮政业	1,331,784.00	0.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,471,762.98	0.45
J	金融业	3,045,655.00	0.55
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	16,866.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	62,627,398.35	11.37

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

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	16,700	21,209,000.00	3.85
2	300750	宁德时代	36,400	14,305,564.00	2.60
3	300502	新易盛	15,140	9,189,980.00	1.67
4	603986	兆易创新	10,400	8,476,000.00	1.54
5	688256	寒武纪	5,114	8,159,642.70	1.48
6	688008	澜起科技	23,525	7,290,397.50	1.32
7	601899	紫金矿业	288,800	7,260,432.00	1.32
8	600519	贵州茅台	5,600	6,638,744.00	1.20
9	002384	东山精密	24,900	6,532,515.00	1.19
10	301308	江波龙	8,600	6,052,680.00	1.10
11	300857	协创数据	17,500	5,948,250.00	1.08
12	300475	香农芯创	18,000	5,400,000.00	0.98
13	300223	北京君正	20,800	5,177,120.00	0.94
14	688525	佰维存储	10,100	4,996,773.00	0.91
15	601318	中国平安	104,100	4,969,734.00	0.90
16	688498	源杰科技	2,600	4,903,600.00	0.89
17	688012	中微公司	10,042	4,704,677.00	0.85
18	600036	招商银行	132,200	4,693,100.00	0.85
19	002475	立讯精密	63,400	4,463,360.00	0.81
20	000333	美的集团	53,400	4,033,302.00	0.73

21	300604	长川科技	11,800	4,028,756.00	0.73
22	002281	光迅科技	15,100	3,879,794.00	0.70
23	300408	三环集团	23,100	3,855,390.00	0.70
24	300458	全志科技	94,700	3,736,862.00	0.68
25	688396	华润微	38,208	3,727,190.40	0.68
26	603259	药明康德	29,900	3,722,849.00	0.68
27	688041	海光信息	9,500	3,517,850.00	0.64
28	300476	胜宏科技	10,000	3,464,300.00	0.63
29	688981	中芯国际	21,200	3,366,984.00	0.61
30	002049	紫光国微	37,500	3,328,125.00	0.60
31	603993	洛阳钼业	189,300	3,322,215.00	0.60
32	600487	亨通光电	29,500	3,225,530.00	0.59
33	300661	圣邦股份	22,000	3,156,560.00	0.57
34	300442	润泽科技	37,600	3,123,432.00	0.57
35	000425	徐工机械	383,500	3,102,515.00	0.56
36	002532	天山铝业	288,800	3,098,824.00	0.56
37	002202	金风科技	128,500	3,071,150.00	0.56
38	600900	长江电力	114,600	3,033,462.00	0.55
39	600150	中国船舶	89,700	3,030,963.00	0.55
40	002460	赣锋锂业	46,100	3,014,940.00	0.55
41	600522	中天科技	47,800	2,900,504.00	0.53
42	000938	紫光股份	99,500	2,871,570.00	0.52
43	600875	东方电气	98,600	2,836,722.00	0.51
44	601166	兴业银行	168,400	2,788,704.00	0.51
45	000338	潍柴动力	102,200	2,784,950.00	0.51
46	600031	三一重工	157,700	2,725,056.00	0.49
47	300496	中科创达	43,300	2,675,507.00	0.49
48	000408	藏格矿业	37,500	2,599,500.00	0.47
49	000034	神州数码	92,000	2,553,000.00	0.46
50	600489	中金黄金	140,500	2,536,025.00	0.46
51	300054	鼎龙股份	23,900	2,532,683.00	0.46
52	002195	岩山科技	387,200	2,532,288.00	0.46
53	300919	中伟新材	57,600	2,520,000.00	0.46
54	601398	工商银行	356,300	2,519,041.00	0.46
55	002517	恺英网络	153,500	2,494,375.00	0.45
56	002371	北方华创	2,800	2,476,768.00	0.45
57	600499	科达制造	176,300	2,432,940.00	0.44
58	000792	盐湖股份	79,100	2,388,029.00	0.43
59	688469	芯联集成	222,700	2,362,847.00	0.43
60	688002	睿创微纳	15,200	2,351,288.00	0.43
61	600039	四川路桥	299,900	2,345,218.00	0.43
62	600482	中国动力	70,300	2,305,840.00	0.42
63	601117	中国化学	298,900	2,196,915.00	0.40
64	688099	晶晨股份	21,200	2,181,480.00	0.40

65	600941	中国移动	25,200	2,170,476.00	0.39
66	600938	中国海油	79,000	2,144,850.00	0.39
67	601328	交通银行	333,300	2,143,119.00	0.39
68	000975	山金国际	125,900	2,140,300.00	0.39
69	002156	通富微电	27,900	2,116,773.00	0.38
70	600406	国电南瑞	91,500	2,090,775.00	0.38
71	600089	特变电工	92,800	2,088,000.00	0.38
72	600547	山东黄金	89,900	2,075,791.00	0.38
73	688472	阿特斯	191,000	2,066,620.00	0.38
74	002463	沪电股份	13,300	2,032,240.00	0.37
75	600111	北方稀土	41,200	1,979,660.00	0.36
76	688521	芯原股份	5,300	1,967,042.00	0.36
77	601615	明阳智能	168,500	1,949,545.00	0.35
78	688676	金盘科技	23,000	1,946,720.00	0.35
79	600673	东阳光	57,500	1,930,850.00	0.35
80	000725	京东方 A	220,700	1,915,676.00	0.35
81	300450	先导智能	46,500	1,893,480.00	0.34
82	600893	航发动力	49,300	1,890,162.00	0.34
83	600989	宝丰能源	92,300	1,876,459.00	0.34
84	600460	士兰微	34,300	1,874,838.00	0.34
85	000657	中钨高新	19,500	1,866,540.00	0.34
86	600026	中远海能	103,000	1,847,820.00	0.34
87	300394	天孚通信	5,940	1,797,919.20	0.33
88	002080	中材科技	19,800	1,782,000.00	0.32
89	300782	卓胜微	16,100	1,764,238.00	0.32
90	603806	福斯特	104,700	1,757,913.00	0.32
91	002600	领益智造	101,300	1,756,542.00	0.32
92	002415	海康威视	51,000	1,744,200.00	0.32
93	000933	神火股份	81,400	1,725,680.00	0.31
94	600030	中信证券	58,500	1,680,705.00	0.31
95	601179	中国西电	111,800	1,668,056.00	0.30
96	601100	恒立液压	15,400	1,656,424.00	0.30
97	300339	润和软件	42,800	1,648,228.00	0.30
98	688347	华虹宏力	4,900	1,647,870.00	0.30
99	002648	卫星化学	69,300	1,627,857.00	0.30
100	688047	龙芯中科	10,500	1,624,035.00	0.29
101	600372	中航机载	148,600	1,612,310.00	0.29
102	600988	赤峰黄金	60,400	1,589,728.00	0.29
103	300124	汇川技术	23,500	1,558,755.00	0.28
104	600887	伊利股份	64,000	1,533,440.00	0.28
105	600276	恒瑞医药	29,300	1,524,772.00	0.28
106	601872	招商轮船	86,600	1,521,562.00	0.28
107	002414	高德红外	114,400	1,516,944.00	0.28
108	000988	华工科技	8,200	1,513,802.00	0.27

109	000651	格力电器	40,300	1,511,250.00	0.27
110	300274	阳光电源	9,400	1,494,788.00	0.27
111	601728	中国电信	285,300	1,480,707.00	0.27
112	002555	三七互娱	78,000	1,471,860.00	0.27
113	603799	华友钴业	30,400	1,467,104.00	0.27
114	300418	昆仑万维	35,800	1,444,888.00	0.26
115	601000	唐山港	332,900	1,381,535.00	0.25
116	688266	泽璟制药	11,500	1,341,590.00	0.24
117	002821	凯莱英	8,140	1,318,680.00	0.24
118	601857	中国石油	149,900	1,301,132.00	0.24
119	301358	湖南裕能	17,100	1,297,377.00	0.24
120	601360	三六零	149,000	1,294,810.00	0.24
121	601288	农业银行	210,700	1,278,949.00	0.23
122	002155	湖南黄金	52,900	1,262,723.00	0.23
123	300136	信维通信	10,500	1,252,125.00	0.23
124	002352	顺丰控股	40,000	1,250,400.00	0.23
125	300014	亿纬锂能	19,200	1,248,576.00	0.23
126	300015	爱尔眼科	147,100	1,215,046.00	0.22
127	000157	中联重科	170,900	1,191,173.00	0.22
128	002709	天赐材料	23,100	1,188,033.00	0.22
129	300390	天华新能	12,700	1,187,577.00	0.22
130	002466	天齐锂业	19,300	1,183,476.00	0.21
131	600018	上港集团	244,900	1,155,928.00	0.21
132	601766	中国中车	220,300	1,145,560.00	0.21
133	688166	博瑞医药	32,600	1,141,326.00	0.21
134	601727	上海电气	159,300	1,115,100.00	0.20
135	600028	中国石化	248,000	1,106,080.00	0.20
136	688213	思特威	10,200	1,092,114.00	0.20
137	002266	浙富控股	212,800	1,076,768.00	0.20
138	002008	大族激光	6,800	1,020,748.00	0.19
139	000538	云南白药	21,400	1,013,718.00	0.18
140	300012	华测检测	72,300	1,002,078.00	0.18
141	000617	中油资本	149,700	986,523.00	0.18
142	002738	中矿资源	16,500	973,335.00	0.18
143	002001	新和成	33,200	943,544.00	0.17
144	300142	沃森生物	72,500	941,775.00	0.17
145	600019	宝钢股份	171,300	930,159.00	0.17
146	000001	平安银行	92,500	929,625.00	0.17
147	600183	生益科技	5,200	901,680.00	0.16
148	000807	云铝股份	40,400	894,456.00	0.16
149	000426	兴业银锡	26,700	880,032.00	0.16
150	002138	顺络电子	12,000	877,200.00	0.16
151	300395	菲利华	6,500	869,245.00	0.16
152	002273	水晶光电	22,800	808,944.00	0.15

153	000100	TCL 科技	135,600	789,192.00	0.14
154	300573	兴齐眼药	19,350	788,706.00	0.14
155	002916	深南电路	1,700	778,430.00	0.14
156	600050	中国联通	192,900	771,600.00	0.14
157	600160	巨化股份	13,800	731,538.00	0.13
158	688063	派能科技	13,700	729,799.00	0.13
159	300760	迈瑞医疗	5,300	719,899.00	0.13
160	600535	天士力	54,300	718,389.00	0.13
161	601668	中国建筑	162,500	705,250.00	0.13
162	600741	华域汽车	43,400	673,568.00	0.12
163	300409	道氏技术	33,300	663,669.00	0.12
164	300432	富临精工	33,000	662,970.00	0.12
165	300759	康龙化成	22,900	662,497.00	0.12
166	300037	新宙邦	7,100	659,235.00	0.12
167	600233	圆通速递	41,200	648,900.00	0.12
168	002756	永兴材料	11,300	640,032.00	0.12
169	000035	中国天楹	130,700	631,281.00	0.11
170	000858	五粮液	8,500	629,000.00	0.11
171	600497	驰宏锌锗	51,100	618,821.00	0.11
172	300433	蓝思科技	11,400	611,724.00	0.11
173	688578	艾力斯	5,600	611,520.00	0.11
174	601225	陕西煤业	29,800	606,430.00	0.11
175	002044	美年健康	120,000	603,600.00	0.11
176	600549	厦门钨业	7,000	596,400.00	0.11
177	000423	东阿阿胶	13,100	594,216.00	0.11
178	300457	赢合科技	27,500	579,700.00	0.11
179	688390	固德威	5,300	575,103.00	0.10
180	002294	信立泰	18,000	574,020.00	0.10
181	601018	宁波港	182,000	573,300.00	0.10
182	300049	福瑞医科	14,700	571,536.00	0.10
183	601607	上海医药	37,100	571,340.00	0.10
184	600711	盛屯矿业	51,900	569,343.00	0.10
185	300059	东方财富	27,800	566,564.00	0.10
186	603650	彤程新材	5,700	558,486.00	0.10
187	002028	思源电气	3,200	553,600.00	0.10
188	300073	当升科技	11,500	552,460.00	0.10
189	688120	华海清科	1,700	547,706.00	0.10
190	002065	东华软件	76,100	543,354.00	0.10
191	300017	网宿科技	41,700	542,517.00	0.10
192	600998	九州通	115,200	540,288.00	0.10
193	300677	英科医疗	13,700	536,629.00	0.10
194	000039	中集集团	65,600	532,016.00	0.10
195	600104	上汽集团	53,900	526,064.00	0.10
196	000977	浪潮信息	7,500	525,000.00	0.10

197	600660	福耀玻璃	10,300	519,532.00	0.09
198	000623	吉林敖东	28,700	508,851.00	0.09
199	300003	乐普医疗	42,900	508,365.00	0.09
200	600309	万华化学	6,800	465,188.00	0.08
201	300001	特锐德	11,800	446,394.00	0.08
202	002472	双环传动	10,600	440,006.00	0.08
203	002236	大华股份	25,300	417,197.00	0.08
204	002230	科大讯飞	10,200	416,568.00	0.08
205	601628	中国人寿	11,500	406,525.00	0.07
206	688111	金山办公	1,900	404,795.00	0.07
207	603979	金诚信	6,400	377,792.00	0.07
208	600886	国投电力	27,900	371,349.00	0.07
209	600415	小商品城	36,100	366,776.00	0.07
210	002603	以岭药业	24,200	363,000.00	0.07
211	300033	同花顺	1,500	361,500.00	0.07
212	600346	恒力石化	20,200	357,742.00	0.06
213	603606	东方电缆	8,280	343,702.80	0.06
214	603288	海天味业	10,300	341,548.00	0.06
215	603501	豪威集团	3,600	341,460.00	0.06
216	600316	洪都航空	12,200	340,868.00	0.06
217	002318	久立特材	14,200	339,380.00	0.06
218	002128	电投能源	14,500	335,240.00	0.06
219	600699	均胜电子	14,900	321,989.00	0.06
220	300748	金力永磁	10,300	317,755.00	0.06
221	600323	瀚蓝环境	10,800	296,568.00	0.05
222	603659	璞泰来	10,200	295,086.00	0.05
223	688188	柏楚电子	2,625	280,087.50	0.05
224	605117	德业股份	2,520	267,573.60	0.05
225	000998	隆平高科	35,200	265,408.00	0.05
226	002497	雅化集团	12,900	262,773.00	0.05
227	601677	明泰铝业	15,500	257,300.00	0.05
228	000960	锡业股份	5,900	251,871.00	0.05
229	600760	中航沈飞	5,700	234,270.00	0.04
230	600166	福田汽车	57,600	167,616.00	0.03
231	688617	惠泰医疗	900	163,404.00	0.03
232	601816	京沪高铁	21,300	96,489.00	0.02
233	601988	中国银行	16,800	96,096.00	0.02
234	600895	张江高科	2,300	85,675.00	0.02
235	601799	星宇股份	900	81,558.00	0.01
236	600196	复星医药	3,000	67,410.00	0.01
237	600795	国电电力	13,800	64,446.00	0.01
238	600570	恒生电子	2,900	61,451.00	0.01
239	600585	海螺水泥	3,400	57,630.00	0.01
240	600038	中直股份	2,000	50,580.00	0.01

241	600219	南山铝业	11,700	46,683.00	0.01
242	600312	平高电气	2,500	44,150.00	0.01
243	600588	用友网络	3,900	35,802.00	0.01
244	603019	中科曙光	300	32,169.00	0.01
245	603392	万泰生物	1,100	29,667.00	0.01
246	600690	海尔智家	1,200	24,492.00	0.00
247	601689	拓普集团	300	16,926.00	0.00
248	601888	中国中免	300	16,113.00	0.00
249	600011	华能国际	2,000	15,180.00	0.00
250	600905	三峡能源	3,100	11,501.00	0.00
251	002493	荣盛石化	1,000	10,750.00	0.00
252	601800	中国交建	1,400	7,994.00	0.00
253	688303	大全能源	400	6,972.00	0.00

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	301165	锐捷网络	30,300	2,437,635.00	0.44
2	603929	亚翔集成	8,300	2,257,766.00	0.41
3	603283	赛腾股份	27,850	2,255,293.00	0.41
4	001287	中电港	69,700	2,171,155.00	0.39
5	300913	兆龙互连	44,800	2,146,368.00	0.39
6	601096	宏盛华源	483,100	2,096,654.00	0.38
7	002015	协鑫能科	124,900	2,038,368.00	0.37
8	002531	天顺风能	234,900	1,980,207.00	0.36
9	300628	亿联网络	55,600	1,880,392.00	0.34
10	603915	国茂股份	121,600	1,725,504.00	0.31
11	301200	大族数控	4,700	1,695,055.00	0.31
12	688387	信科移动	81,700	1,620,928.00	0.29
13	300580	贝斯特	74,400	1,496,184.00	0.27
14	301536	星宸科技	11,600	1,493,036.00	0.27
15	002487	大金重工	25,500	1,478,235.00	0.27
16	601399	国机重装	402,300	1,408,050.00	0.26
17	688182	灿勤科技	31,900	1,373,933.00	0.25
18	603305	旭升集团	111,000	1,345,320.00	0.24
19	002518	科士达	24,800	1,329,032.00	0.24
20	002142	宁波银行	44,200	1,312,298.00	0.24
21	003031	中瓷电子	7,200	1,298,160.00	0.24
22	002379	宏桥控股	86,100	1,271,697.00	0.23
23	603296	华勤技术	15,620	1,160,097.40	0.21
24	002320	海峡股份	176,200	1,104,774.00	0.20
25	300903	科翔股份	9,700	982,707.00	0.18

26	002624	完美世界	78,600	976,212.00	0.18
27	000629	钒钛股份	284,300	949,562.00	0.17
28	601068	中铝国际	215,200	929,664.00	0.17
29	688027	国盾量子	1,800	907,218.00	0.16
30	600919	江苏银行	78,700	848,386.00	0.15
31	301396	宏景科技	2,400	795,840.00	0.14
32	601231	环旭电子	24,200	784,080.00	0.14
33	605365	立达信	54,300	780,834.00	0.14
34	300953	震裕科技	5,500	735,350.00	0.13
35	300687	赛意信息	22,300	691,300.00	0.13
36	002716	湖南白银	83,900	678,751.00	0.12
37	688800	瑞可达	7,000	671,790.00	0.12
38	002396	星网锐捷	34,800	667,116.00	0.12
39	603538	美诺华	19,900	647,745.00	0.12
40	688019	安集科技	1,900	644,974.00	0.12
41	601212	白银有色	123,700	628,396.00	0.11
42	301328	维峰电子	8,400	598,080.00	0.11
43	001326	联域股份	9,900	586,971.00	0.11
44	300373	扬杰科技	3,400	534,582.00	0.10
45	600563	法拉电子	2,600	496,080.00	0.09
46	301150	中一科技	6,720	424,099.20	0.08
47	002841	视源股份	11,200	386,736.00	0.07
48	000543	皖能电力	44,100	333,837.00	0.06
49	600114	东睦股份	8,700	328,512.00	0.06
50	601869	长飞光纤	600	327,540.00	0.06
51	002701	奥瑞金	75,700	322,482.00	0.06
52	000690	宝新能源	66,500	312,550.00	0.06
53	300341	麦克奥迪	23,400	310,050.00	0.06
54	000612	焦作万方	28,900	306,051.00	0.06
55	301246	宏源药业	11,300	303,970.00	0.06
56	601939	建设银行	30,700	295,641.00	0.05
57	002948	青岛银行	54,800	278,384.00	0.05
58	300548	长芯博创	1,000	278,000.00	0.05
59	002245	蔚蓝锂芯	14,404	269,498.84	0.05
60	001248	华润新能源	25,791	260,747.01	0.05
61	601061	中信金属	21,100	227,247.00	0.04
62	601298	青岛港	28,200	227,010.00	0.04
63	601688	华泰证券	9,500	195,890.00	0.04
64	002039	黔源电力	9,100	171,262.00	0.03
65	000729	燕京啤酒	16,800	170,184.00	0.03
66	688629	华丰科技	525	98,442.75	0.02
67	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.02
68	688820	盛合晶微	598	84,611.02	0.02
69	001399	惠科股份	2,874	79,696.02	0.01

70	000155	川能动力	6,600	79,068.00	0.01
71	002966	苏州银行	8,800	61,248.00	0.01
72	600958	东方证券	5,700	53,808.00	0.01
73	601138	工业富联	600	43,290.00	0.01
74	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.01
75	688635	长进光子	128	39,448.32	0.01
76	001257	盛龙股份	1,614	33,474.36	0.01
77	600577	精达股份	3,000	29,340.00	0.01
78	688712	北芯生命	733	26,329.36	0.00
79	603459	红板科技	272	22,935.04	0.00
80	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
81	001365	天海电子	555	17,377.05	0.00
82	300244	迪安诊断	900	16,866.00	0.00
83	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
84	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
85	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
86	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
87	001237	惠康科技	233	13,686.42	0.00
88	301683	慧谷新材	88	10,715.76	0.00
89	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
90	688343	云天励飞	103	8,410.98	0.00
91	301680	固德电材	74	8,299.84	0.00
92	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
93	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
94	603025	大豪科技	300	4,092.00	0.00
95	688816	易思维	71	4,054.10	0.00
96	601112	振石股份	151	2,656.09	0.00
97	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
98	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
99	688772	珠海冠宇	88	1,727.44	0.00
100	688128	中国电研	71	1,685.54	0.00
101	603284	林平发展	35	1,220.45	0.00
102	688006	杭可科技	26	950.30	0.00
103	688443	智翔金泰	9	209.25	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	30,983,555.00	18.83
2	300308	中际旭创	26,358,556.00	16.02
3	601899	紫金矿业	17,466,882.00	10.62
4	601318	中国平安	13,238,397.00	8.05
5	300502	新易盛	13,218,635.60	8.03
6	603986	兆易创新	12,167,741.00	7.40
7	603993	洛阳钼业	11,803,739.61	7.17
8	688256	寒武纪	10,953,939.85	6.66
9	002475	立讯精密	10,103,797.00	6.14
10	603799	华友钴业	10,079,958.10	6.13
11	688981	中芯国际	10,041,725.52	6.10
12	688008	澜起科技	9,882,627.39	6.01
13	600519	贵州茅台	9,683,219.77	5.89
14	300408	三环集团	9,571,923.00	5.82
15	002532	天山铝业	9,316,331.00	5.66
16	300274	阳光电源	9,190,884.00	5.59
17	002460	赣锋锂业	9,140,467.40	5.56
18	600150	中国船舶	8,804,272.00	5.35
19	300014	亿纬锂能	8,536,662.76	5.19
20	600008	首创环保	8,457,285.00	5.14
21	300223	北京君正	8,454,428.00	5.14
22	000807	云铝股份	8,442,440.00	5.13
23	688396	华润微	8,394,265.89	5.10
24	000933	神火股份	8,255,057.00	5.02
25	601328	交通银行	8,244,474.00	5.01
26	000725	京东方 A	8,191,918.00	4.98
27	600499	科达制造	8,138,125.77	4.95
28	601601	中国太保	8,074,077.54	4.91
29	300433	蓝思科技	8,038,880.00	4.89
30	600031	三一重工	7,984,225.35	4.85
31	300627	华测导航	7,907,187.40	4.81
32	600036	招商银行	7,842,492.00	4.77
33	000338	潍柴动力	7,794,001.00	4.74
34	688213	思特威	7,722,547.36	4.69
35	000333	美的集团	7,712,693.00	4.69
36	002415	海康威视	7,666,657.85	4.66
37	300919	中伟新材	7,656,780.40	4.65
38	002558	巨人网络	7,644,273.00	4.65
39	601677	明泰铝业	7,634,894.00	4.64
40	002266	浙富控股	7,576,505.00	4.61
41	601166	兴业银行	7,561,867.00	4.60
42	002185	华天科技	7,478,854.00	4.55
43	002841	视源股份	7,408,826.45	4.50
44	301308	江波龙	7,305,880.00	4.44

45	002463	沪电股份	7,215,598.00	4.39
46	000651	格力电器	7,208,900.90	4.38
47	600887	伊利股份	7,167,963.00	4.36
48	002273	水晶光电	7,141,539.00	4.34
49	000408	藏格矿业	7,125,290.00	4.33
50	000792	盐湖股份	7,063,827.28	4.29
51	002384	东山精密	7,061,372.00	4.29
52	002414	高德红外	7,030,714.40	4.27
53	603259	药明康德	7,020,088.04	4.27
54	688012	中微公司	7,008,302.10	4.26
55	300604	长川科技	6,974,606.00	4.24
56	002709	天赐材料	6,951,900.00	4.23
57	601088	中国神华	6,900,445.00	4.19
58	300628	亿联网络	6,876,514.00	4.18
59	688041	海光信息	6,868,666.85	4.17
60	600019	宝钢股份	6,859,015.00	4.17
61	300394	天孚通信	6,792,661.20	4.13
62	601615	明阳智能	6,748,713.00	4.10
63	600030	中信证券	6,712,411.75	4.08
64	605117	德业股份	6,672,943.72	4.06
65	000425	徐工机械	6,612,603.00	4.02
66	300857	协创数据	6,604,957.88	4.01
67	601600	中国铝业	6,581,314.00	4.00
68	000932	华菱钢铁	6,572,740.00	4.00
69	002600	领益智造	6,556,241.00	3.98
70	600372	中航机载	6,534,636.00	3.97
71	688002	睿创微纳	6,522,201.40	3.96
72	601225	陕西煤业	6,486,687.32	3.94
73	300759	康龙化成	6,486,393.00	3.94
74	601888	中国中免	6,468,084.00	3.93
75	300450	先导智能	6,382,912.83	3.88
76	601728	中国电信	6,365,728.00	3.87
77	600406	国电南瑞	6,312,983.01	3.84
78	600309	万华化学	6,291,735.50	3.82
79	300142	沃森生物	6,278,280.00	3.82
80	300073	当升科技	6,271,277.00	3.81
81	300003	乐普医疗	6,198,971.00	3.77
82	600875	东方电气	6,183,176.40	3.76
83	002281	光迅科技	6,159,552.00	3.74
84	300457	赢合科技	6,137,945.00	3.73
85	002049	紫光国微	6,126,933.00	3.72
86	601117	中国化学	6,119,905.00	3.72
87	000100	TCL 科技	6,074,480.00	3.69
88	002156	通富微电	6,070,964.00	3.69

89	000063	中兴通讯	5,965,752.00	3.63
90	600893	航发动力	5,858,073.00	3.56
91	600941	中国移动	5,841,840.74	3.55
92	300037	新宙邦	5,832,972.00	3.55
93	600489	中金黄金	5,830,761.00	3.54
94	000157	中联重科	5,819,855.00	3.54
95	300476	胜宏科技	5,796,409.45	3.52
96	688036	传音控股	5,770,579.58	3.51
97	601398	工商银行	5,715,695.00	3.47
98	000975	山金国际	5,661,411.40	3.44
99	002821	凯莱英	5,640,610.20	3.43
100	603806	福斯特	5,593,105.00	3.40
101	002544	普天科技	5,587,506.00	3.40
102	601360	三六零	5,582,359.00	3.39
103	002241	歌尔股份	5,544,689.62	3.37
104	688111	金山办公	5,542,473.59	3.37
105	600584	长电科技	5,527,754.00	3.36
106	600900	长江电力	5,496,729.00	3.34
107	600026	中远海能	5,466,266.00	3.32
108	600522	中天科技	5,454,892.00	3.32
109	300580	贝斯特	5,450,631.00	3.31
110	601000	唐山港	5,422,245.00	3.30
111	601872	招商轮船	5,350,835.70	3.25
112	000977	浪潮信息	5,299,308.00	3.22
113	600039	四川路桥	5,273,317.00	3.21
114	000035	中国天楹	5,266,647.33	3.20
115	300124	汇川技术	5,146,143.00	3.13
116	601288	农业银行	5,109,751.00	3.11
117	600938	中国海油	5,082,851.00	3.09
118	300475	香农芯创	5,009,502.07	3.04
119	002340	格林美	4,950,866.00	3.01
120	600183	生益科技	4,945,538.00	3.01
121	600547	山东黄金	4,918,450.00	2.99
122	002044	美年健康	4,898,158.00	2.98
123	600104	上汽集团	4,892,882.00	2.97
124	600276	恒瑞医药	4,802,538.00	2.92
125	600028	中国石化	4,794,592.00	2.91
126	601727	上海电气	4,792,616.00	2.91
127	002444	巨星科技	4,791,392.00	2.91
128	300442	润泽科技	4,766,889.00	2.90
129	600460	士兰微	4,756,123.00	2.89
130	300558	贝达药业	4,731,280.02	2.88
131	601100	恒立液压	4,725,865.00	2.87
132	600741	华域汽车	4,707,214.00	2.86

133	002916	深南电路	4,698,429.00	2.86
134	002152	广电运通	4,695,275.00	2.85
135	300001	特锐德	4,688,015.56	2.85
136	300760	迈瑞医疗	4,652,583.00	2.83
137	601816	京沪高铁	4,631,243.00	2.81
138	002138	顺络电子	4,600,630.00	2.80
139	600166	福田汽车	4,590,324.00	2.79
140	301358	湖南裕能	4,530,597.00	2.75
141	300207	欣旺达	4,526,474.00	2.75
142	601668	中国建筑	4,521,103.00	2.75
143	688498	源杰科技	4,487,405.00	2.73
144	300496	中科创达	4,462,395.00	2.71
145	603019	中科曙光	4,446,358.00	2.70
146	600487	亨通光电	4,428,132.71	2.69
147	688166	博瑞医药	4,424,258.05	2.69
148	002008	大族激光	4,418,815.00	2.69
149	000887	中鼎股份	4,409,548.00	2.68
150	600362	江西铜业	4,371,084.00	2.66
151	688472	阿特斯	4,364,052.30	2.65
152	600050	中国联通	4,311,680.00	2.62
153	600585	海螺水泥	4,300,789.00	2.61
154	301219	腾远钴业	4,295,017.00	2.61
155	300136	信维通信	4,273,764.00	2.60
156	600361	创新新材	4,270,769.00	2.60
157	600352	浙江龙盛	4,266,762.00	2.59
158	600038	中直股份	4,256,501.00	2.59
159	002371	北方华创	4,252,940.00	2.59
160	300088	长信科技	4,242,562.00	2.58
161	601216	君正集团	4,229,427.00	2.57
162	600808	马钢股份	4,228,736.00	2.57
163	000768	中航西飞	4,224,122.00	2.57
164	688525	佰维存储	4,175,654.69	2.54
165	600570	恒生电子	4,133,856.00	2.51
166	600176	中国巨石	4,111,216.00	2.50
167	603659	璞泰来	4,098,876.00	2.49
168	600398	海澜之家	4,079,695.00	2.48
169	002701	奥瑞金	4,045,971.00	2.46
170	002555	三七互娱	4,029,154.00	2.45
171	600482	中国动力	4,016,256.38	2.44
172	002517	恺英网络	4,002,375.00	2.43
173	300913	兆龙互连	3,990,954.00	2.43
174	002230	科大讯飞	3,983,809.73	2.42
175	600415	小商品城	3,973,099.00	2.41
176	600320	振华重工	3,937,916.00	2.39

177	300458	全志科技	3,934,663.60	2.39
178	603296	华勤技术	3,925,815.00	2.39
179	601018	宁波港	3,925,384.00	2.39
180	688099	晶晨股份	3,922,141.15	2.38
181	600160	巨化股份	3,918,021.00	2.38
182	688009	中国通号	3,904,152.10	2.37
183	300661	圣邦股份	3,893,853.00	2.37
184	603606	东方电缆	3,878,044.00	2.36
185	002028	思源电气	3,853,121.00	2.34
186	601058	赛轮轮胎	3,830,152.00	2.33
187	300316	晶盛机电	3,797,782.00	2.31
188	601898	中煤能源	3,791,532.00	2.30
189	300418	昆仑万维	3,776,342.00	2.30
190	001287	中电港	3,775,942.00	2.30
191	002497	雅化集团	3,773,847.00	2.29
192	600018	上港集团	3,757,131.00	2.28
193	300347	泰格医药	3,746,090.00	2.28
194	600760	中航沈飞	3,724,665.00	2.26
195	601168	西部矿业	3,722,553.00	2.26
196	002202	金风科技	3,711,298.00	2.26
197	600673	东阳光	3,700,766.00	2.25
198	600111	北方稀土	3,691,546.00	2.24
199	600426	华鲁恒升	3,687,512.00	2.24
200	000733	振华科技	3,659,374.00	2.22
201	600177	雅戈尔	3,657,568.68	2.22
202	002195	岩山科技	3,651,482.00	2.22
203	002938	鹏鼎控股	3,586,947.00	2.18
204	688182	灿勤科技	3,576,542.68	2.17
205	002466	天齐锂业	3,564,505.80	2.17
206	000034	神州数码	3,549,169.60	2.16
207	000938	紫光股份	3,545,224.00	2.15
208	601766	中国中车	3,527,855.00	2.14
209	600196	复星医药	3,501,597.00	2.13
210	300782	卓胜微	3,497,400.00	2.13
211	000630	铜陵有色	3,483,124.00	2.12
212	002493	荣盛石化	3,481,362.00	2.12
213	002436	兴森科技	3,478,209.00	2.11
214	002271	东方雨虹	3,477,277.00	2.11
215	600968	海油发展	3,441,759.00	2.09
216	002001	新和成	3,431,317.60	2.09
217	600919	江苏银行	3,423,705.00	2.08
218	600219	南山铝业	3,357,965.00	2.04
219	601857	中国石油	3,303,421.00	2.01
220	001979	招商蛇口	3,298,451.00	2.00

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	25,230,834.90	15.34
2	300308	中际旭创	19,966,691.00	12.14
3	300408	三环集团	11,450,710.20	6.96
4	601899	紫金矿业	11,092,042.00	6.74
5	603986	兆易创新	10,777,868.00	6.55
6	300502	新易盛	10,287,221.60	6.25
7	601318	中国平安	10,154,427.00	6.17
8	688981	中芯国际	9,524,762.35	5.79
9	603993	洛阳钼业	8,832,426.00	5.37
10	000725	京东方 A	8,730,787.00	5.31
11	300433	蓝思科技	8,437,356.00	5.13
12	300274	阳光电源	8,381,354.00	5.09
13	601601	中国太保	8,368,800.00	5.09
14	600008	首创环保	8,231,215.10	5.00
15	603799	华友钴业	8,196,884.00	4.98
16	002475	立讯精密	8,124,966.00	4.94
17	300014	亿纬锂能	7,995,845.00	4.86
18	002463	沪电股份	7,839,385.80	4.76
19	601677	明泰铝业	7,819,878.00	4.75
20	300627	华测导航	7,782,589.00	4.73
21	002185	华天科技	7,521,942.00	4.57
22	688256	寒武纪	7,514,851.82	4.57
23	002558	巨人网络	7,473,336.00	4.54
24	002415	海康威视	6,999,760.00	4.25
25	605117	德业股份	6,987,004.86	4.25
26	688213	思特威	6,931,159.90	4.21
27	002266	浙富控股	6,866,422.00	4.17
28	002241	歌尔股份	6,863,891.00	4.17
29	600584	长电科技	6,817,633.00	4.14
30	000807	云铝股份	6,816,172.00	4.14
31	002273	水晶光电	6,753,796.00	4.11
32	300223	北京君正	6,729,438.00	4.09
33	002841	视源股份	6,725,873.00	4.09
34	688008	澜起科技	6,699,685.84	4.07
35	601088	中国神华	6,670,266.00	4.05
36	688396	华润微	6,580,115.58	4.00
37	600887	伊利股份	6,548,879.00	3.98

38	000063	中兴通讯	6,547,327.00	3.98
39	600019	宝钢股份	6,486,587.00	3.94
40	600030	中信证券	6,293,378.00	3.83
41	601328	交通银行	6,193,973.00	3.76
42	002916	深南电路	6,191,364.00	3.76
43	002709	天赐材料	6,168,683.01	3.75
44	300394	天孚通信	6,166,837.03	3.75
45	601888	中国中免	6,159,744.50	3.74
46	002414	高德红外	6,086,246.00	3.70
47	000100	TCL 科技	6,075,154.00	3.69
48	601600	中国铝业	6,012,350.00	3.65
49	600183	生益科技	6,004,836.00	3.65
50	000333	美的集团	6,001,283.35	3.65
51	300037	新宙邦	5,992,569.00	3.64
52	000932	华菱钢铁	5,948,835.00	3.62
53	300457	赢合科技	5,923,987.95	3.60
54	603259	药明康德	5,905,980.00	3.59
55	600309	万华化学	5,850,343.43	3.56
56	688036	传音控股	5,845,652.07	3.55
57	002156	通富微电	5,799,847.00	3.53
58	601225	陕西煤业	5,778,455.48	3.51
59	002460	赣锋锂业	5,752,836.68	3.50
60	300759	康龙化成	5,706,880.50	3.47
61	601728	中国电信	5,683,080.00	3.45
62	600406	国电南瑞	5,647,421.00	3.43
63	000338	潍柴动力	5,628,130.00	3.42
64	300604	长川科技	5,575,866.00	3.39
65	601166	兴业银行	5,509,888.00	3.35
66	000651	格力电器	5,502,911.00	3.34
67	600150	中国船舶	5,422,242.00	3.30
68	600519	贵州茅台	5,289,872.00	3.22
69	600166	福田汽车	5,277,463.00	3.21
70	300142	沃森生物	5,268,913.00	3.20
71	600522	中天科技	5,238,443.00	3.18
72	300073	当升科技	5,234,891.13	3.18
73	600499	科达制造	5,200,210.00	3.16
74	300003	乐普医疗	5,181,577.00	3.15
75	688111	金山办公	5,165,804.50	3.14
76	688041	海光信息	5,147,493.12	3.13
77	002600	领益智造	5,126,480.00	3.12
78	000792	盐湖股份	5,100,956.00	3.10
79	000977	浪潮信息	5,090,510.00	3.09
80	002821	凯莱英	5,075,556.00	3.09
81	300207	欣旺达	5,057,026.00	3.07

82	002544	普天科技	5,039,629.00	3.06
83	000933	神火股份	5,029,013.00	3.06
84	600372	中航机载	5,020,278.46	3.05
85	600031	三一重工	5,012,013.00	3.05
86	000157	中联重科	4,914,416.70	2.99
87	688002	睿创微纳	4,909,650.83	2.98
88	002340	格林美	4,877,326.00	2.96
89	300919	中伟新材	4,851,259.00	2.95
90	601615	明阳智能	4,832,975.00	2.94
91	601872	招商轮船	4,825,329.00	2.93
92	603659	璞泰来	4,802,249.00	2.92
93	300628	亿联网络	4,800,864.00	2.92
94	600176	中国巨石	4,789,428.00	2.91
95	300558	贝达药业	4,783,088.00	2.91
96	002444	巨星科技	4,766,322.00	2.90
97	002532	天山铝业	4,740,300.00	2.88
98	300124	汇川技术	4,739,602.00	2.88
99	603019	中科曙光	4,728,755.00	2.87
100	300088	长信科技	4,709,858.00	2.86
101	000035	中国天楹	4,686,160.16	2.85
102	600104	上汽集团	4,671,710.00	2.84
103	300001	特锐德	4,643,412.00	2.82
104	688012	中微公司	4,620,358.00	2.81
105	600036	招商银行	4,593,721.00	2.79
106	601816	京沪高铁	4,548,465.00	2.76
107	600585	海螺水泥	4,522,490.00	2.75
108	000768	中航西飞	4,483,097.00	2.72
109	002044	美年健康	4,424,208.00	2.69
110	000887	中鼎股份	4,418,598.00	2.69
111	600460	士兰微	4,390,496.00	2.67
112	000408	藏格矿业	4,385,018.00	2.67
113	600570	恒生电子	4,360,586.80	2.65
114	002152	广电运通	4,354,073.00	2.65
115	600050	中国联通	4,327,926.00	2.63
116	002938	鹏鼎控股	4,323,127.00	2.63
117	601216	君正集团	4,295,111.00	2.61
118	300450	先导智能	4,293,423.00	2.61
119	600900	长江电力	4,292,021.00	2.61
120	600352	浙江龙盛	4,249,852.00	2.58
121	600415	小商品城	4,196,594.00	2.55
122	600361	创新新材	4,193,562.00	2.55
123	002138	顺络电子	4,168,167.00	2.53
124	301219	腾远钴业	4,153,898.90	2.52
125	601288	农业银行	4,138,947.00	2.52

126	601360	三六零	4,136,832.00	2.51
127	603806	福斯特	4,128,248.20	2.51
128	601168	西部矿业	4,121,534.00	2.51
129	600362	江西铜业	4,113,545.00	2.50
130	600497	驰宏锌锗	4,099,806.00	2.49
131	601000	唐山港	4,065,013.00	2.47
132	688009	中国通号	4,062,627.93	2.47
133	600941	中国移动	4,059,253.00	2.47
134	600026	中远海能	4,051,716.00	2.46
135	600893	航发动力	4,034,576.00	2.45
136	601668	中国建筑	4,011,091.00	2.44
137	600160	巨化股份	3,961,357.00	2.41
138	002008	大族激光	3,956,692.00	2.40
139	601058	赛轮轮胎	3,935,597.00	2.39
140	601398	工商银行	3,929,717.00	2.39
141	300316	晶盛机电	3,922,309.00	2.38
142	600760	中航沈飞	3,909,119.36	2.38
143	600808	马钢股份	3,894,930.00	2.37
144	300347	泰格医药	3,889,003.00	2.36
145	600028	中国石化	3,879,867.00	2.36
146	601898	中煤能源	3,872,261.00	2.35
147	600038	中直股份	3,852,005.00	2.34
148	600398	海澜之家	3,837,910.00	2.33
149	600741	华域汽车	3,831,267.48	2.33
150	688166	博瑞医药	3,830,113.78	2.33
151	002049	紫光国微	3,827,267.00	2.33
152	600320	振华重工	3,818,861.00	2.32
153	600276	恒瑞医药	3,814,693.00	2.32
154	600690	海尔智家	3,801,195.00	2.31
155	300760	迈瑞医疗	3,790,836.00	2.30
156	605589	圣泉集团	3,716,820.00	2.26
157	301308	江波龙	3,714,957.00	2.26
158	301358	湖南裕能	3,703,330.00	2.25
159	000967	盈峰环境	3,666,358.00	2.23
160	600875	东方电气	3,652,963.00	2.22
161	600219	南山铝业	3,652,725.00	2.22
162	300580	贝斯特	3,652,034.00	2.22
163	601012	隆基绿能	3,621,252.64	2.20
164	600196	复星医药	3,610,877.00	2.19
165	300136	信维通信	3,595,920.70	2.19
166	601117	中国化学	3,589,993.00	2.18
167	600177	雅戈尔	3,583,422.28	2.18
168	601727	上海电气	3,563,462.00	2.17
169	002230	科大讯飞	3,555,703.00	2.16

170	601138	工业富联	3,539,561.00	2.15
171	000733	振华科技	3,516,618.00	2.14
172	000630	铜陵有色	3,500,037.00	2.13
173	002493	荣盛石化	3,483,475.00	2.12
174	002271	东方雨虹	3,474,361.00	2.11
175	002436	兴森科技	3,467,210.00	2.11
176	002701	奥瑞金	3,462,561.00	2.10
177	603606	东方电缆	3,436,777.00	2.09
178	601766	中国中车	3,417,173.00	2.08
179	300476	胜宏科技	3,400,088.00	2.07
180	002371	北方华创	3,398,161.00	2.07
181	302132	中航成飞	3,337,748.00	2.03
182	002028	思源电气	3,330,447.00	2.02
183	688303	大全能源	3,325,257.27	2.02
184	600968	海油发展	3,311,696.00	2.01
185	002603	以岭药业	3,292,815.01	2.00

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

买入股票成本（成交）总额	2,014,178,672.87
卖出股票收入（成交）总额	1,705,384,003.80

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	14,234,758.45	2.58
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	14,234,758.45	2.58

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	019827	26 国债 01	60,000	6,038,891.51	1.10
2	019785	25 国债 13	31,000	3,139,138.99	0.57
3	019792	25 国债 19	30,000	3,031,476.99	0.55
4	102310	国债 2513	20,000	2,025,250.96	0.37

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 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	1,073,630.14
2	应收清算款	5,625,661.51
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,906,991.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,606,283.48

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

本基金本报告期末积极投资前五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	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
海富通中证 A500 指数增强 A	1,711	145,847.19	17,385,233.51	6.97%	232,159,314.08	93.03%
海富通中证 A500 指数增强 C	1,376	104,232.39	22,223,463.38	15.49%	121,200,306.16	84.51%
合计	3,087	127,297.80	39,608,696.89	10.08%	353,359,620.24	89.92%

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 A500 指数增强 A	78,105.23	0.0313%
	海富通中证 A500 指数增强 C	185,285.65	0.1292%
	合计	263,390.88	0.0670%

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 A500 指数增强 A	0
	海富通中证 A500 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通中证 A500 指数增强 A	0~10
	海富通中证 A500 指数增强 C	10~50

	合计	10~50
--	----	-------

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,002,083.54	2.55%	10,002,083.54	2.55%	不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,002,083.54	2.55%	10,002,083.54	2.55%	-

注：本基金募集期间，本基金管理人运用固有资金作为发起资金总计 1,000.10 万元认购了本基金，其中，认购费用为 1,000.00 元，符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定。发起资金认购的基金份额自基金合同生效之日起持有不少于 3 年。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通中证 A500 指数增强 A	海富通中证 A500 指数增强 C
基金合同生效日（2025 年 3 月 25 日）基金份额总额	147,867,531.69	84,793,807.69
本报告期期初基金份额总额	95,545,001.24	38,006,330.11
本报告期基金总申购份额	470,620,545.28	327,321,340.28
减：本报告期基金总赎回份额	316,620,998.93	221,903,900.85
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	249,544,547.59	143,423,769.54

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	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	2	2,905,184,411.37	78.14%	540,066.61	78.13%	-
国泰海通证券	3	812,966,008.46	21.86%	151,130.63	21.87%	-

注：1、本基金本报告期新增国泰海通证券 1 个交易单元。

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
华泰证券	15,703,898.00	100.00%	26,000,000.00	100.00%	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-

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基金新增上海基煜基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-19
2	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)	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
3	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-01
4	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-23
5	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-23
6	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海中欧财富基金销售有限公司为销售	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金	2026-04-28

	机构并参加其申购费率优惠活动的公告	电子披露网站	
7	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-30
8	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增深圳前海微众银行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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-19
9	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-21
10	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-23
11	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	上海证券报、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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

§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 指数增强型发起式证券投资基金的文件
- (二)海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同
- (三)海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书
- (四)海富通中证 A500 指数增强型发起式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