

泓德中证 A500 指数增强型证券投资基金

2025 年中期报告

2025 年 06 月 30 日

基金管理人:泓德基金管理有限公司

基金托管人:广发证券股份有限公司

送出日期:2025 年 08 月 29 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，并由董事长签发。

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2025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2025年3月11日（基金合同生效日）起至2025年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
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	7
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合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
§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	60
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62
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	63
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	63
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	63
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	63
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	63
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63
7.12 投资组合报告附注	64
§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	65
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情况.....	66
§9 开放式基金份额变动.....	66
§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.....	67
10.4 基金投资策略的改变	67
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	67
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	67
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	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
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	70
§12 备查文件目录.....	70
12.1 备查文件目录	70
12.2 存放地点.....	70
12.3 查阅方式.....	70

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泓德中证A500指数增强型证券投资基金	
基金简称	泓德中证A500指数增强	
基金主代码	023335	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025年03月11日	
基金管理人	泓德基金管理有限公司	
基金托管人	广发证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	139,499,666.81份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	泓德中证A500指数增强A	泓德中证A500指数增强C
下属分级基金的交易代码	023335	023336
报告期末下属分级基金的份额总额	63,403,860.70份	76,095,806.11份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制，力争实现长期超越标的指数的业绩表现。
投资策略	本基金以中证A500指数为标的指数，主要采用指数增强量化投资策略，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年跟踪误差不超过8.0%，并力争在控制跟踪误差的基础上获得超越标的指数的超额收益。主要投资策略包括：股票投资策略、债券投资策略、金融衍生品投资策略及融资、转融通证券出借业务投资策略等。
业绩比较基准	中证A500指数收益率×95%＋银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时，本基金主要投资于标的指数成份股及其

	备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。
--	-------------------------

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泓德基金管理有限公司	广发证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李娇	罗琦
	联系电话	010-59850151	020-66338888
	电子邮箱	lijiao@hongdefund.com	gzluoqi@gf.com.cn
客户服务电话		4009-100-888	95575
传真		010-59850195	020-87553363-6847
注册地址		西藏自治区拉萨市柳梧新区 北京大道柳梧城投大厦A-120 6-1	广东省广州市黄埔区中新广 州知识城腾飞一街2号618室
办公地址		北京市西城区德胜门外大街1 25号	广州市天河区马场路26号广 发证券大厦34楼
邮政编码		100088	510627
法定代表人		王德晓	林传辉

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.hongdefund.com
基金中期报告备置地点	北京市西城区德胜门外大街125号

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	泓德基金管理有限公司	北京市西城区德胜门外大街125号

§3 主要财务指标和基金净值表现

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 (2025年03月11日（基金合同生效日）-2025年06月30日)	
	泓德中证A500指数增强A	泓德中证A500指数增强C
本期已实现收益	5,532,505.45	5,718,152.67
本期利润	7,628,623.50	7,408,411.66
加权平均基金份额本期利润	0.0495	0.0433
本期加权平均净值利润率	4.92%	4.30%
本期基金份额净值增长率	6.42%	6.28%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2025年06月30日)	
期末可供分配利润	3,632,620.24	4,259,659.51
期末可供分配基金份额利润	0.0573	0.0560
期末基金资产净值	67,471,715.52	80,877,159.54
期末基金份额净值	1.0642	1.0628
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2025年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	6.42%	6.28%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

4、本基金基金合同生效日为2025年3月11日，本期财务报表的实际编制期间为2025年3月11日至2025年6月30日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

泓德中证A500指数增强A

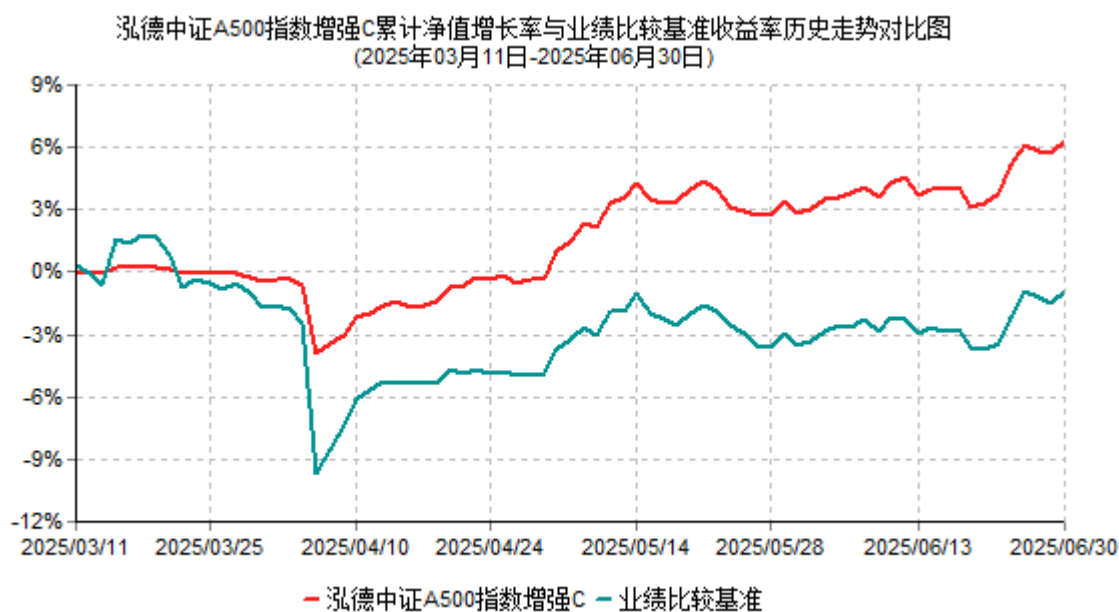
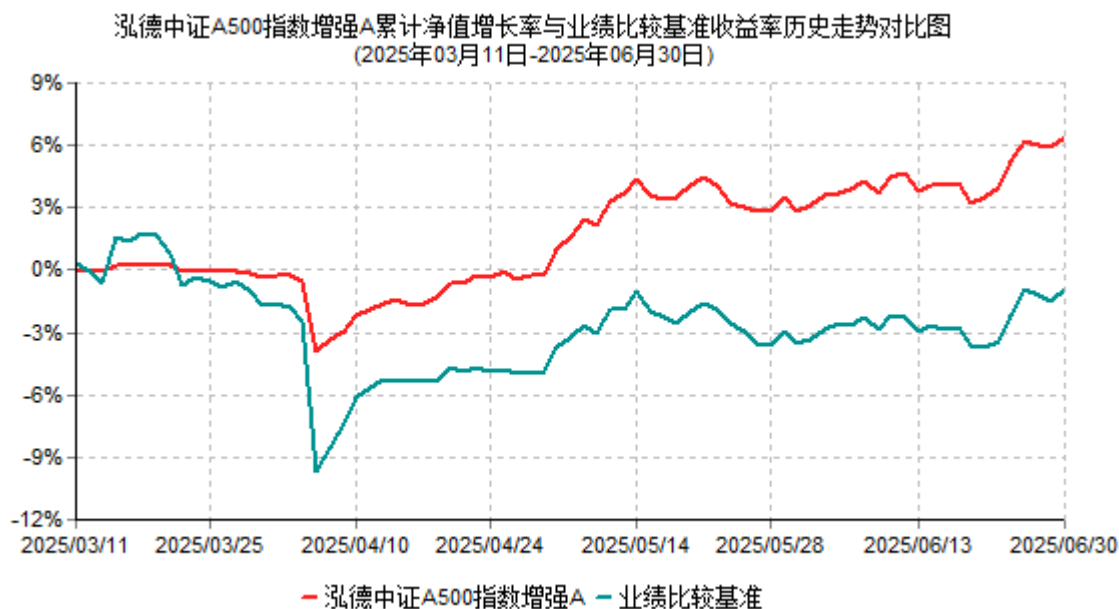
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	3.44%	0.52%	2.68%	0.57%	0.76%	-0.05%
过去三个月	6.83%	0.66%	0.83%	1.14%	6.00%	-0.48%
自基金合同 生效起至今	6.42%	0.59%	-0.93%	1.08%	7.35%	-0.49%

泓德中证A500指数增强C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	3.40%	0.52%	2.68%	0.57%	0.72%	-0.05%
过去三个月	6.71%	0.66%	0.83%	1.14%	5.88%	-0.48%
自基金合同 生效起至今	6.28%	0.59%	-0.93%	1.08%	7.21%	-0.49%

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

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



注：1、本基金的基金合同于2025年3月11日生效，截至2025年6月30日止，本基金成立未满1年。

2、本基金建仓期为6个月，截至2025年6月30日止，本基金建仓期尚未结束。

3、建仓期结束后，本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围及投资限制规定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

未来公司将继续秉持投资者利益至上的初心，不断精进，推动公司高质量发展。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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

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

2、证券从业的含义遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，A股整体呈现上涨趋势，成交量较为活跃，小盘股好于大盘股，成长风格优于价值风格，过去两年一枝独秀的红利板块出现回调，概念轮动此消彼长，年初的DeepSeek行情、一季度的机器人行情和贯穿整个上半年的创新药行情也让中国的硬科技价值得到重估。交投活跃且震荡向上的市场对量化策略也较为友好，虽然4月7日美国“对等关税”推出导致市场短期出现恐慌，但我们逐步建仓的策略降低了产品净值的回撤，后续的超额收益也总体稳健，我们在风格暴露上相对较为克制，努力避免因风格收益的大幅波动而造成的超额收益大幅波动，但同时我们也在努力迭代模型，力争让模型更好地适应市场。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末泓德中证A500指数增强A基金份额净值为1.0642元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为6.42%，同期业绩比较基准收益率为-0.93%；截至报告期末泓德中证A500指数增强C基金份额净值为1.0628元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为6.28%，同期业绩比较基准收益率为-0.93%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年中国科技股出现了明显的估值修复，背后源于我们在硬科技研发上不断的厚积薄发，DeepSeek的横空出世让我们看到了我国自主大模型广阔的发展前景，机器人的百花齐放让我们看到了具身智能的可能性，我们在AI领域拥有大量的人才储备，广阔的下游市场空间和丰厚的资本支持，我们也有理由相信我国AI的发展不是昙花一现，未来的机会很多；创新药领域同样值得期待，我国FIC数量的占比显著提升、License-out交易额逐步提高，是对我国创新药领域政策扶持、融资便利和科学家红利的最好体现。当然，硬科技板块的繁荣和宽松的宏观环境与投资者较高的风险偏好息息相关。宏观方面，上半年宏观经济在险峻的外部环境下依然表现出较好韧性，GDP同比增长5.3%，在补贴等促消费政策的拉动下，消费成为促进GDP增长的主要动力，“抢出口”行为虽然一定程度上预支了出口需求，但也使得在二季度巨大关税威胁冲击下，出口依然对上半年经济增长做出较大贡献，投资总体承压，但结构有所改善，新质生产力加速发展。展望下半年，随着宏观政策的不断发力，国内大循环不断强化，经济稳中向好的发展态势不会改变。回到资本市场，市场的不断上涨也带动了投资者的做多热情，成交量稳步抬升，我们也会继续完善深度学习选股模型，努力通过多模型多策略的方式为投资者创造更好收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

本基金截至2025年06月30日，期末可供分配利润为7,892,279.75元，其中：泓德中证A500指数增强A期末可供分配利润为3,632,620.24元（泓德中证A500指数增强A的未分配利润已实现部分为3,632,620.24元，未分配利润未实现部分为435,234.58元），泓德中证A500指数增强C期末可供分配利润为4,259,659.51元（泓德中证A500指数增强C的未分配利润已实现部分为4,259,659.51元，未分配利润未实现部分为521,693.92元）。

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

本报告期内，本基金管理人无应说明的预警信息。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本基金托管人依法对泓德基金管理有限公司编制和披露的泓德中证A500指数增强型证券投资基金2025年中期报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：泓德中证A500指数增强型证券投资基金

报告截止日：2025年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025年06月30日
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	13,863,359.53
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	136,712,448.11
其中：股票投资		136,706,747.81
基金投资		-
债券投资		5,700.30
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		163,279.98
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		150,739,087.62
负 债 和 净 资 产	附注号	本期末 2025年06月30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		-
应付赎回款		2,177,195.81
应付管理人报酬		109,763.35
应付托管费		20,580.65
应付销售服务费		29,325.89
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	53,346.86
负债合计		2,390,212.56
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	139,499,666.81
未分配利润	6.4.7.8	8,849,208.25
净资产合计		148,348,875.06
负债和净资产总计		150,739,087.62

注：报告截止日2025年06月30日，基金份额总额139,499,666.81份，其中A类基金份额总额为63,403,860.70份，基金份额净值为1.0642元；C类基金份额总额为76,095,806.11份，基金份额净值为1.0628元。

6.2 利润表

会计主体：泓德中证A500指数增强型证券投资基金

本报告期：2025年03月11日（基金合同生效日）至2025年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025年03月11日（基金合同 生效日）至2025年06月30 日
一、营业总收入		16,237,973.33

1.利息收入		529,079.19
其中：存款利息收入	6.4.7.9	529,079.19
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		11,920,975.85
其中：股票投资收益	6.4.7.10	9,481,551.77
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	48.00
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.12	-
股利收益	6.4.7.13	2,439,376.08
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	3,786,377.04
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	1,541.25
减：二、营业总支出		1,200,938.17
1.管理人报酬		791,522.29
2.托管费		148,410.51
3.销售服务费		208,031.61
4.投资顾问费		-
5.利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.信用减值损失		-
7.税金及附加		-
8.其他费用	6.4.7.16	52,973.76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		15,037,035.16

减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		15,037,035.16
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		15,037,035.16

6.3 净资产变动表

会计主体：泓德中证A500指数增强型证券投资基金

本报告期：2025年03月11日（基金合同生效日）至2025年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2025年03月11日（基金合同生效日）至2025年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	476,910,499.70	-	476,910,499.70
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-337,410,832.89	8,849,208.25	-328,561,624.64
（一）、综合收益总额	-	15,037,035.16	15,037,035.16
（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）	-337,410,832.89	-6,187,826.91	-343,598,659.80
其中：1.基金申购款	13,405,782.20	421,580.37	13,827,362.57
2.基金赎回款	-350,816,615.09	-6,609,407.28	-357,426,022.37
（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	139,499,666.81	8,849,208.25	148,348,875.06

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:

王德晓	王德晓	王玲
-----	-----	-----
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

泓德中证A500指数增强型证券投资基金（以下简称"本基金"）经中国证券监督管理委员会（以下简称"中国证监会"）证监许可[2025]37号《关于准予泓德中证A500指数增强型证券投资基金注册的批复》准予注册，由泓德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泓德中证A500指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式。存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集476,792,483.26元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2025）验字第80014975_A03号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泓德中证A500指数增强型证券投资基金基金合同》于2025年3月11日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为476,910,499.70份，其中认购资金利息折合118,016.44份基金份额。本基金的基金管理人为泓德基金管理有限公司，基金托管人为广发证券股份有限公司。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泓德中证A500指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标：本基金为股票指数增强型基金，通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制，力争实现长期超越标的指数的业绩表现。本基金的投资范围主要包括国内依法发行上市的股票（含主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政

府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与融资、转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产（含存托凭证）占基金资产的比例不低于基金资产的80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证A500指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2025年3月11日（基金合同生效日）至2025年6月30日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2025年6月30日的财务状况以及2025年3月11日（基金合同生效日）至2025年6月30日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2025年3月11日（基金合同生效日）至2025年6月30日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产

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

债务工具

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

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

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

(2) 金融负债

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

(3) 衍生金融工具

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

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

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

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

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

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

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理

人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

根据财政部、税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品提供的

贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让2017年12月31日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价（2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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 2025年06月30日
活期存款	8,087,076.12
等于：本金	8,084,266.08
加：应计利息	2,810.04
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	5,776,283.41
等于：本金	5,776,124.40
加：应计利息	159.01
减：坏账准备	-
合计	13,863,359.53

注：其他存款为存放在证券经纪机构的证券资金账户中的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		132,920,370.77	-	136,706,747.81	3,786,377.04
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	5,700.00	0.30	5,700.30	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	5,700.00	0.30	5,700.30	-

资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	132,926,070.77	0.30	136,712,448.11	3,786,377.04

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

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

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年06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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	52,973.76
其他应付	373.10
合计	53,346.86

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 泓德中证A500指数增强A

金额单位：人民币元

项目 (泓德中证A500指数增强A)	本期 2025年03月11日（基金合同生效日）至2025年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	223,494,536.04	223,494,536.04
本期申购	2,523,163.06	2,523,163.06
本期赎回（以“-”号填列）	-162,613,838.40	-162,613,838.40
本期末	63,403,860.70	63,403,860.70

6.4.7.7.2 泓德中证A500指数增强C

金额单位：人民币元

项目 (泓德中证A500指数增强C)	本期 2025年03月11日（基金合同生效日）至2025年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	253,415,963.66	253,415,963.66
本期申购	10,882,619.14	10,882,619.14
本期赎回（以“-”号填列）	-188,202,776.69	-188,202,776.69
本期末	76,095,806.11	76,095,806.11

注: 1、申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

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

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

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

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 泓德中证A500指数增强A

单位：人民币元

项目 (泓德中证A500指数增强A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	5,532,505.45	2,096,118.05	7,628,623.50
本期基金份额交易产生的变动数	-1,899,885.21	-1,660,883.47	-3,560,768.68
其中：基金申购款	85,918.22	14,160.60	100,078.82
基金赎回款	-1,985,803.43	-1,675,044.07	-3,660,847.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,632,620.24	435,234.58	4,067,854.82

6.4.7.8.2 泓德中证A500指数增强C

单位：人民币元

项目 (泓德中证A500指数增强C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	5,718,152.67	1,690,258.99	7,408,411.66
本期基金份额交易产生的变动数	-1,458,493.16	-1,168,565.07	-2,627,058.23
其中：基金申购款	313,673.46	7,828.09	321,501.55
基金赎回款	-1,772,166.62	-1,176,393.16	-2,948,559.78
本期已分配利润	-	-	-

本期末	4,259,659.51	521,693.92	4,781,353.43
-----	--------------	------------	--------------

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年03月11日（基金合同生效日）至2025年06月30日
活期存款利息收入	522,642.37
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	6,436.82
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	529,079.19

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

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年03月11日（基金合同生效日）至2025年06月30日
卖出股票成交总额	484,854,737.47
减：卖出股票成本总额	474,857,575.66
减：交易费用	515,610.04
买卖股票差价收入	9,481,551.77

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 2025年03月11日（基金合同生效日）至2025年06月30日
----	--

债券投资收益——利息收入	0.39
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	47.61
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	48.00

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 2025年03月11日（基金合同生效日）至2025年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	247.71
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	200.00
减：应计利息总额	0.09
减：交易费用	0.01
买卖债券差价收入	47.61

6.4.7.12 衍生工具收益

无。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年03月11日（基金合同生效日）至2025年06月30日
股票投资产生的股利收益	2,439,376.08
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	2,439,376.08
----	--------------

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年03月11日（基金合同生效日）至2025年06月30日
1.交易性金融资产	3,786,377.04
——股票投资	3,786,377.04
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	3,786,377.04

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年03月11日（基金合同生效日）至2025年06月30日
基金赎回费收入	1,389.35
基金转换费收入	151.90
合计	1,541.25

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

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

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年03月11日（基金合同生效日）至2025年06月30日
审计费用	15,135.68
信息披露费	37,838.08
证券出借违约金	-
合计	52,973.76

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

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

无。

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
泓德基金管理有限公司（以下简称“泓德基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
广发证券股份有限公司（以下简称“广发证券”）	基金托管人、基金销售机构

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

无。

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 2025年03月11日（基金合同生效日）至2025年 06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	791,522.29
其中：应支付销售机构的客户维护费	385,952.76
应支付基金管理人的净管理费	405,569.53

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年03月11日（基金合同生效日）至2025年06月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	148,410.51

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

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 2025年03月11日（基金合同生效日）至2025年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泓德中证A500指数增强A	泓德中证A500指数增强C	合计
广发证券	0.00	92,446.20	92,446.20
合计	0.00	92,446.20	92,446.20

注：支付基金销售机构的C类基金份额销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.40%的年费率每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付给泓德基金，再由泓德基

金计算并支付给各基金销售机构。A类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：
日销售服务费=前一日C类基金份额基金资产净值×0.40%/当年天数。

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

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2025年03月11日（基金合同生效日）至2025年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
广发证券	8,087,076.12	522,642.37

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

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2025年06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
001388	信通电子	2025-06-24	5个交易日	新股未上市	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
301678	新恒汇	2025-06-13	6个月以上	限售股	12.80	44.54	281	3,596.80	12,515.74	-
603400	华之杰	2025-06-12	6个月以上	限售股	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
603382	海阳科技	2025-06-05	6个月以上	限售股	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-
001388	信通电子	2025-06-24	6个月以上	新股未上市且限售	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113695	华辰转债	2025-06-23	13个交易日	新债未上市	100.00	100.00	40	4,000.00	4,000.19	-
123257	安克转债	2025-06-16	14个交易日	新债未上市	100.00	100.01	17	1,700.00	1,700.11	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。基金参与申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让，其中基金参

与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

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

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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

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

于本报告期期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券(若有)占基金资产净值的比例为0%。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，除在“6.4.12期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限的情况外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025年06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	13,863,359.53	-	-	-	13,863,359.53
交易性金融资产	-	-	5,700.30	136,706,747.81	136,712,448.11
应收申购款	-	-	-	163,279.98	163,279.98
资产总计	13,863,359.53	-	5,700.30	136,870,027.79	150,739,087.62
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,177,195.81	2,177,195.81
应付管理人报酬	-	-	-	109,763.35	109,763.35
应付托管费	-	-	-	20,580.65	20,580.65
应付销售服务费	-	-	-	29,325.89	29,325.89
其他负债	-	-	-	53,346.86	53,346.86
负债总计	-	-	-	2,390,212.56	2,390,212.56
利率敏感度缺口	13,863,359.53	-	5,700.30	134,479,815.23	148,348,875.06

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期期末，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券（若有）公允价值占基金资产净值的比例为0.00%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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或银行间同业市场交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时地对风险进行跟踪和控制。

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 2025年06月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	136,706,747.81	92.15
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	136,706,747.81	92.15

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于本报告期期末，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

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的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

- 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
- 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
- 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

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 2025年06月30日
第一层次	136,673,998.41
第二层次	21,085.84
第三层次	17,363.86
合计	136,712,448.11

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，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§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	136,706,747.81	90.69
	其中：股票	136,706,747.81	90.69
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,700.30	0.00
	其中：债券	5,700.30	0.00
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	13,863,359.53	9.20
8	其他各项资产	163,279.98	0.11
9	合计	150,739,087.62	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（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	113,427.00	0.08
B	采矿业	5,007,411.00	3.38
C	制造业	60,353,044.48	40.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,652,994.00	2.46
E	建筑业	3,029,167.00	2.04
F	批发和零售业	3,870,145.00	2.61

G	交通运输、仓储和邮政业	4,120,818.00	2.78
H	住宿和餐饮业	35,904.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,520,586.80	4.40
J	金融业	19,906,470.00	13.42
K	房地产业	1,740,684.00	1.17
L	租赁和商务服务业	1,100,441.00	0.74
M	科学研究和技术服务业	792,870.00	0.53
N	水利、环境和公共设施管理业	1,120,871.00	0.76
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	103,584.00	0.07
R	文化、体育和娱乐业	197,739.00	0.13
S	综合	-	-
	合计	111,666,156.28	75.27

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	205,403.00	0.14
B	采矿业	70,796.00	0.05
C	制造业	19,279,039.36	13.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	344,237.00	0.23
E	建筑业	60,025.00	0.04
F	批发和零售业	689,726.00	0.46
G	交通运输、仓储和邮政业	33,496.00	0.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,444,546.40	0.97

J	金融业	627,339.00	0.42
K	房地产业	230,790.00	0.16
L	租赁和商务服务业	79,477.00	0.05
M	科学研究和技术服务业	512,405.77	0.35
N	水利、环境和公共设施管理业	781,382.00	0.53
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	681,929.00	0.46
S	综合	-	-
	合计	25,040,591.53	16.88

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	3,300	4,651,416.00	3.14
2	300750	宁德时代	14,700	3,707,634.00	2.50
3	601318	中国平安	64,000	3,550,720.00	2.39
4	600036	招商银行	65,900	3,028,105.00	2.04
5	601166	兴业银行	104,900	2,448,366.00	1.65
6	000333	美的集团	31,800	2,295,960.00	1.55
7	600900	长江电力	74,800	2,254,472.00	1.52
8	601899	紫金矿业	94,800	1,848,600.00	1.25
9	600919	江苏银行	140,900	1,682,346.00	1.13
10	600887	伊利股份	56,000	1,561,280.00	1.05
11	000725	京东方 A	360,600	1,438,794.00	0.97

12	000651	格力电器	31,900	1,432,948.00	0.97
13	601398	工商银行	182,400	1,384,416.00	0.93
14	600030	中信证券	43,300	1,195,946.00	0.81
15	601328	交通银行	147,200	1,177,600.00	0.79
16	300059	东方财富	48,900	1,131,057.00	0.76
17	002594	比亚迪	3,400	1,128,494.00	0.76
18	600000	浦发银行	79,300	1,100,684.00	0.74
19	601728	中国电信	136,400	1,057,100.00	0.71
20	600050	中国联通	186,900	998,046.00	0.67
21	601600	中国铝业	134,700	948,288.00	0.64
22	600019	宝钢股份	142,600	939,734.00	0.63
23	000100	TCL科技	214,600	929,218.00	0.63
24	601766	中国中车	125,800	885,632.00	0.60
25	601319	中国人保	91,300	795,223.00	0.54
26	603259	药明康德	11,400	792,870.00	0.53
27	600741	华域汽车	44,700	788,955.00	0.53
28	601288	农业银行	133,100	782,628.00	0.53
29	002236	大华股份	48,500	770,180.00	0.52
30	601877	正泰电器	33,200	752,644.00	0.51
31	601857	中国石油	86,600	740,430.00	0.50
32	000425	徐工机械	94,700	735,819.00	0.50
33	002266	浙富控股	237,700	732,116.00	0.49
34	600998	九州通	141,900	729,366.00	0.49
35	601006	大秦铁路	105,200	694,320.00	0.47
36	000858	五粮液	5,800	689,620.00	0.46
37	688188	柏楚电子	5,180	681,998.80	0.46
38	600153	建发股份	65,500	679,235.00	0.46
39	002625	光启技术	16,800	671,664.00	0.45
40	600176	中国巨石	58,800	670,320.00	0.45
41	002532	天山铝业	79,800	663,138.00	0.45
42	600276	恒瑞医药	12,500	648,750.00	0.44

43	002001	新 和 成	30,500	648,735.00	0.44
44	002414	高德红外	63,100	646,775.00	0.44
45	600499	科达制造	65,900	645,820.00	0.44
46	601117	中国化学	82,600	633,542.00	0.43
47	601988	中国银行	110,800	622,696.00	0.42
48	600406	国电南瑞	27,000	605,070.00	0.41
49	603993	洛阳钼业	71,700	603,714.00	0.41
50	600585	海螺水泥	27,600	592,572.00	0.40
51	600332	白云山	22,400	590,464.00	0.40
52	000338	潍柴动力	38,100	585,978.00	0.39
53	300408	三环集团	17,500	584,500.00	0.39
54	600989	宝丰能源	36,100	582,654.00	0.39
55	600335	国机汽车	88,800	572,760.00	0.39
56	002463	沪电股份	13,400	570,572.00	0.38
57	600039	四川路桥	57,600	570,240.00	0.38
58	601668	中国建筑	98,700	569,499.00	0.38
59	601186	中国铁建	69,600	557,496.00	0.38
60	600219	南山铝业	145,000	555,350.00	0.37
61	002091	江苏国泰	76,300	554,701.00	0.37
62	300628	亿联网络	15,500	538,780.00	0.36
63	600704	物产中大	97,300	512,771.00	0.35
64	002493	荣盛石化	61,000	505,080.00	0.34
65	600160	巨化股份	17,400	499,032.00	0.34
66	688223	晶科能源	94,400	489,936.00	0.33
67	601919	中远海控	32,200	484,288.00	0.33
68	000301	东方盛虹	58,100	483,973.00	0.33
69	002230	科大讯飞	10,100	483,588.00	0.33
70	600803	新奥股份	25,200	476,280.00	0.32
71	002384	东山精密	12,600	475,902.00	0.32
72	001965	招商公路	39,300	471,600.00	0.32
73	605499	东鹏饮料	1,500	471,075.00	0.32

74	601607	上海医药	26,000	464,880.00	0.31
75	600018	上港集团	81,400	464,794.00	0.31
76	688981	中芯国际	5,202	458,660.34	0.31
77	002128	电投能源	23,100	456,918.00	0.31
78	600660	福耀玻璃	8,000	456,080.00	0.31
79	600418	江淮汽车	11,300	453,017.00	0.31
80	688009	中国通号	87,876	451,682.64	0.30
81	601816	京沪高铁	78,200	449,650.00	0.30
82	000708	中信特钢	38,100	448,056.00	0.30
83	600655	豫园股份	80,500	446,775.00	0.30
84	600233	圆通速递	34,600	445,994.00	0.30
85	002624	完美世界	29,100	441,447.00	0.30
86	300017	网宿科技	40,700	436,304.00	0.29
87	600867	通化东宝	52,500	430,500.00	0.29
88	000001	平安银行	35,600	429,692.00	0.29
89	600007	中国国贸	20,700	426,006.00	0.29
90	600031	三一重工	23,300	418,235.00	0.28
91	600941	中国移动	3,700	416,435.00	0.28
92	600362	江西铜业	17,500	410,025.00	0.28
93	603885	吉祥航空	30,400	409,488.00	0.28
94	603260	合盛硅业	8,500	402,900.00	0.27
95	300274	阳光电源	5,900	399,843.00	0.27
96	002027	分众传媒	54,300	396,390.00	0.27
97	600177	雅戈尔	53,600	391,280.00	0.26
98	002352	顺丰控股	8,000	390,080.00	0.26
99	002841	视源股份	11,200	387,520.00	0.26
100	002508	老板电器	20,200	384,002.00	0.26
101	001914	招商积余	30,800	380,996.00	0.26
102	600667	太极实业	56,800	373,744.00	0.25
103	600104	上汽集团	23,100	370,755.00	0.25
104	600048	保利发展	45,700	370,170.00	0.25

105	000963	华东医药	9,100	367,276.00	0.25
106	000975	山金国际	19,300	365,542.00	0.25
107	603087	甘李药业	6,500	356,070.00	0.24
108	600674	川投能源	21,700	348,068.00	0.23
109	603799	华友钴业	9,400	347,988.00	0.23
110	600637	东方明珠	46,300	345,861.00	0.23
111	603501	豪威集团	2,700	344,655.00	0.23
112	601677	明泰铝业	27,700	344,034.00	0.23
113	600482	中国动力	14,900	343,743.00	0.23
114	300088	长信科技	56,400	336,144.00	0.23
115	600346	恒力石化	23,100	329,406.00	0.22
116	000538	云南白药	5,900	329,161.00	0.22
117	600028	中国石化	58,300	328,812.00	0.22
118	600886	国投电力	22,300	328,702.00	0.22
119	600131	国网信通	18,300	323,910.00	0.22
120	600563	法拉电子	2,900	316,361.00	0.21
121	002202	金风科技	30,800	315,700.00	0.21
122	002475	立讯精密	9,000	312,210.00	0.21
123	000977	浪潮信息	6,100	310,368.00	0.21
124	600487	亨通光电	20,200	309,060.00	0.21
125	600089	特变电工	25,700	306,601.00	0.21
126	600398	海澜之家	44,000	306,240.00	0.21
127	600085	同仁堂	8,400	302,904.00	0.20
128	000157	中联重科	41,400	299,322.00	0.20
129	600885	宏发股份	13,360	298,061.60	0.20
130	601658	邮储银行	54,300	297,021.00	0.20
131	600352	浙江龙盛	29,200	296,672.00	0.20
132	002138	顺络电子	10,300	289,636.00	0.20
133	000988	华工科技	6,000	282,060.00	0.19
134	600745	闻泰科技	8,400	281,652.00	0.19
135	600183	生益科技	9,300	280,395.00	0.19

136	002179	中航光电	6,900	278,484.00	0.19
137	000807	云铝股份	17,100	273,258.00	0.18
138	002648	卫星化学	15,700	272,081.00	0.18
139	601966	玲珑轮胎	18,500	271,395.00	0.18
140	002497	雅化集团	23,200	264,480.00	0.18
141	001979	招商蛇口	30,100	263,977.00	0.18
142	600460	士兰微	10,600	263,092.00	0.18
143	688122	西部超导	5,000	259,400.00	0.17
144	601868	中国能建	116,200	259,126.00	0.17
145	600096	云天化	11,500	252,655.00	0.17
146	603816	顾家家居	9,900	252,648.00	0.17
147	002223	鱼跃医疗	6,800	242,080.00	0.16
148	600038	中直股份	6,200	240,622.00	0.16
149	002318	久立特材	10,100	236,239.00	0.16
150	300037	新宙邦	6,700	235,840.00	0.16
151	600489	中金黄金	16,100	235,543.00	0.16
152	601225	陕西煤业	11,900	228,956.00	0.15
153	002407	多氟多	18,400	224,296.00	0.15
154	601567	三星医疗	10,000	224,200.00	0.15
155	300573	兴齐眼药	4,300	222,697.00	0.15
156	601021	春秋航空	4,000	222,600.00	0.15
157	600511	国药股份	7,600	221,616.00	0.15
158	603568	伟明环保	11,400	217,512.00	0.15
159	300383	光环新网	15,100	215,930.00	0.15
160	002372	伟星新材	20,600	213,416.00	0.14
161	600426	华鲁恒升	9,500	205,865.00	0.14
162	002938	鹏鼎控股	6,400	204,992.00	0.14
163	002572	索菲亚	14,400	201,744.00	0.14
164	002739	万达电影	17,300	197,739.00	0.13
165	601100	恒立液压	2,700	194,400.00	0.13
166	002294	信立泰	4,100	194,053.00	0.13

167	600795	国电电力	39,400	190,696.00	0.13
168	002558	巨人网络	8,000	188,400.00	0.13
169	000999	华润三九	6,010	187,992.80	0.13
170	002831	裕同科技	7,700	180,334.00	0.12
171	600436	片仔癀	900	180,009.00	0.12
172	300760	迈瑞医疗	800	179,800.00	0.12
173	600862	中航高科	6,800	177,344.00	0.12
174	601633	长城汽车	7,800	167,544.00	0.11
175	603833	欧派家居	2,900	163,705.00	0.11
176	300308	中际旭创	1,100	160,446.00	0.11
177	600166	福田汽车	59,200	160,432.00	0.11
178	601238	广汽集团	21,000	157,290.00	0.11
179	603288	海天味业	4,000	155,640.00	0.10
180	002244	滨江集团	15,600	152,100.00	0.10
181	002064	华峰化学	22,600	149,386.00	0.10
182	601233	桐昆股份	13,800	146,280.00	0.10
183	000738	航发控制	6,900	143,175.00	0.10
184	300502	新易盛	1,100	139,722.00	0.09
185	601601	中国太保	3,700	138,787.00	0.09
186	601168	西部矿业	8,200	136,366.00	0.09
187	603899	晨光股份	4,600	133,354.00	0.09
188	300476	胜宏科技	900	120,942.00	0.08
189	603019	中科曙光	1,700	119,680.00	0.08
190	000960	锡业股份	7,800	119,340.00	0.08
191	300413	芒果超媒	5,400	117,828.00	0.08
192	600498	烽火通信	5,500	115,665.00	0.08
193	000035	中国天楹	26,700	114,543.00	0.08
194	002714	牧原股份	2,700	113,427.00	0.08
195	300450	先导智能	4,500	111,825.00	0.08
196	688012	中微公司	600	109,380.00	0.07
197	002415	海康威视	3,900	108,147.00	0.07

198	300015	爱尔眼科	8,300	103,584.00	0.07
199	601628	中国人寿	2,500	102,975.00	0.07
200	688271	联影医疗	800	102,192.00	0.07
201	300118	东方日升	10,300	98,674.00	0.07
202	000002	万 科 A	15,000	96,300.00	0.06
203	603806	福斯特	7,100	92,016.00	0.06
204	000408	藏格矿业	2,100	89,607.00	0.06
205	002371	北方华创	200	88,442.00	0.06
206	002252	上海莱士	12,800	87,936.00	0.06
207	002916	深南电路	810	87,326.10	0.06
208	600066	宇通客车	3,500	87,010.00	0.06
209	000039	中集集团	11,000	86,460.00	0.06
210	688126	沪硅产业	4,600	86,112.00	0.06
211	688396	华润微	1,800	84,888.00	0.06
212	600497	驰宏锌锗	15,200	80,408.00	0.05
213	600845	宝信软件	3,400	80,308.00	0.05
214	300866	安克创新	700	79,520.00	0.05
215	002353	杰瑞股份	2,200	77,000.00	0.05
216	000400	许继电气	3,500	76,195.00	0.05
217	300558	贝达药业	1,300	75,335.00	0.05
218	601799	星宇股份	600	75,000.00	0.05
219	000932	华菱钢铁	17,000	74,800.00	0.05
220	300832	新产业	1,300	73,736.00	0.05
221	688063	派能科技	1,600	72,128.00	0.05
222	002821	凯莱英	800	70,600.00	0.05
223	002595	豪迈科技	1,100	65,142.00	0.04
224	603659	璞泰来	3,400	63,852.00	0.04
225	600535	天士力	3,900	61,035.00	0.04
226	600516	方大炭素	12,900	59,856.00	0.04
227	600699	均胜电子	3,400	59,296.00	0.04
228	000630	铜陵有色	17,200	57,448.00	0.04

229	300070	碧水源	12,600	56,700.00	0.04
230	002410	广联达	4,000	53,640.00	0.04
231	600588	用友网络	4,000	53,480.00	0.04
232	000878	云南铜业	4,200	53,424.00	0.04
233	600196	复星医药	2,100	52,689.00	0.04
234	600111	北方稀土	2,100	52,290.00	0.04
235	600004	白云机场	5,700	51,870.00	0.03
236	600325	华发股份	10,500	51,135.00	0.03
237	300014	亿纬锂能	1,100	50,391.00	0.03
238	688008	澜起科技	600	49,200.00	0.03
239	300001	特锐德	1,900	45,543.00	0.03
240	000568	泸州老窖	400	45,360.00	0.03
241	600256	广汇能源	7,500	45,150.00	0.03
242	688169	石头科技	280	43,834.00	0.03
243	002028	思源电气	600	43,746.00	0.03
244	002078	太阳纸业	2,900	39,034.00	0.03
245	600008	首创环保	12,700	38,354.00	0.03
246	600864	哈投股份	6,400	38,208.00	0.03
247	600820	隧道股份	6,100	37,210.00	0.03
248	600392	盛和资源	2,800	36,876.00	0.02
249	601000	唐山港	8,900	36,134.00	0.02
250	600754	锦江酒店	1,600	35,904.00	0.02
251	603486	科沃斯	600	34,938.00	0.02
252	600690	海尔智家	1,400	34,692.00	0.02
253	000063	中兴通讯	1,000	32,490.00	0.02
254	601618	中国中冶	9,500	28,310.00	0.02
255	000938	紫光股份	1,100	26,389.00	0.02
256	600415	小商品城	1,200	24,816.00	0.02
257	002517	恺英网络	1,100	21,241.00	0.01
258	002185	华天科技	2,100	21,210.00	0.01
259	000629	钒钛股份	7,900	20,224.00	0.01

260	600312	平高电气	1,200	18,468.00	0.01
261	000426	兴业银锡	1,100	17,380.00	0.01
262	600011	华能国际	2,300	16,422.00	0.01
263	300124	汇川技术	200	12,914.00	0.01
264	600438	通威股份	700	11,725.00	0.01
265	002145	中核钛白	2,800	11,620.00	0.01
266	000661	长春高新	100	9,918.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	301106	骏成科技	17,400	518,520.00	0.35
2	603633	徕木股份	50,200	436,238.00	0.29
3	301321	翰博高新	27,300	417,417.00	0.28
4	301539	宏鑫科技	22,400	414,848.00	0.28
5	688509	正元地信	90,013	386,155.77	0.26
6	300559	佳发教育	32,200	379,960.00	0.26
7	300512	中亚股份	41,200	353,496.00	0.24
8	300214	日科化学	51,300	348,327.00	0.23
9	300560	中富通	25,700	347,207.00	0.23
10	605218	伟时电子	15,400	344,652.00	0.23
11	603933	睿能科技	19,900	342,678.00	0.23
12	301189	奥尼电子	12,900	339,399.00	0.23
13	605058	澳弘电子	11,100	339,216.00	0.23
14	688079	美迪凯	32,822	329,532.88	0.22
15	301265	华新环保	31,300	319,260.00	0.22
16	300606	金太阳	15,500	305,660.00	0.21
17	300830	金现代	32,700	298,551.00	0.20
18	002788	鹭燕医药	34,300	293,951.00	0.20

19	002623	亚玛顿	16,800	271,320.00	0.18
20	601218	吉鑫科技	65,800	270,438.00	0.18
21	300625	三雄极光	21,800	259,202.00	0.17
22	000153	丰原药业	41,500	256,055.00	0.17
23	603380	易德龙	9,500	252,700.00	0.17
24	603676	卫信康	24,700	250,211.00	0.17
25	603168	莎普爱思	33,500	247,565.00	0.17
26	603987	康德莱	32,100	247,170.00	0.17
27	000726	鲁泰A	38,300	242,822.00	0.16
28	300407	凯发电气	22,500	237,825.00	0.16
29	001358	兴欣新材	9,900	236,907.00	0.16
30	300667	必创科技	14,600	230,534.00	0.16
31	301362	民爆光电	5,400	220,374.00	0.15
32	688057	金达莱	17,665	215,513.00	0.15
33	300812	易天股份	9,300	214,923.00	0.14
34	600638	新黄浦	36,500	213,890.00	0.14
35	002637	赞宇科技	21,400	213,572.00	0.14
36	301318	维海德	6,300	213,192.00	0.14
37	603628	清源股份	17,200	210,012.00	0.14
38	002863	今飞凯达	41,400	209,898.00	0.14
39	002206	海利得	41,000	209,510.00	0.14
40	300279	和晶科技	30,200	209,286.00	0.14
41	002363	隆基机械	27,500	209,275.00	0.14
42	603230	内蒙新华	16,200	209,142.00	0.14
43	300162	雷曼光电	27,500	209,000.00	0.14
44	603386	骏亚科技	16,500	208,725.00	0.14
45	603916	苏博特	23,000	208,380.00	0.14
46	688055	龙腾光电	56,270	208,199.00	0.14
47	002479	富春环保	41,400	207,414.00	0.14
48	002736	国信证券	18,000	207,360.00	0.14
49	300062	中能电气	38,500	207,130.00	0.14

50	601126	四方股份	12,700	206,629.00	0.14
51	002852	道道全	21,600	206,496.00	0.14
52	002661	克明食品	20,600	206,206.00	0.14
53	002381	双箭股份	30,500	205,875.00	0.14
54	002983	芯瑞达	9,700	205,543.00	0.14
55	002772	众兴菌业	26,300	205,403.00	0.14
56	600757	长江传媒	22,100	205,088.00	0.14
57	601555	东吴证券	23,300	203,875.00	0.14
58	600866	星湖科技	29,500	203,845.00	0.14
59	603898	好莱客	18,500	203,315.00	0.14
60	002976	瑞玛精密	7,800	202,800.00	0.14
61	000719	中原传媒	15,900	197,319.00	0.13
62	605500	森林包装	23,000	169,970.00	0.11
63	605186	健麾信息	7,900	165,426.00	0.11
64	300636	同和药业	20,400	156,672.00	0.11
65	300447	全信股份	9,900	155,133.00	0.10
66	300690	双一科技	6,400	154,944.00	0.10
67	300187	永清环保	30,100	153,510.00	0.10
68	603020	爱普股份	16,000	146,880.00	0.10
69	301151	冠龙节能	8,300	144,835.00	0.10
70	600785	新华百货	12,200	143,106.00	0.10
71	002660	茂硕电源	14,800	139,120.00	0.09
72	002333	罗普斯金	25,200	138,600.00	0.09
73	002722	物产金轮	8,600	138,374.00	0.09
74	001360	南矿集团	9,900	137,808.00	0.09
75	300774	倍杰特	15,700	137,375.00	0.09
76	003016	欣贺股份	18,300	137,250.00	0.09
77	301129	瑞纳智能	4,700	127,652.00	0.09
78	002879	长缆科技	8,000	121,920.00	0.08
79	000626	远大控股	17,800	120,684.00	0.08
80	600496	精工钢构	34,800	111,360.00	0.08

81	300752	隆利科技	4,800	107,904.00	0.07
82	002578	闽发铝业	31,800	106,530.00	0.07
83	688093	世华科技	3,422	106,253.10	0.07
84	600873	梅花生物	9,900	105,831.00	0.07
85	300389	艾比森	9,100	105,378.00	0.07
86	603199	九华旅游	2,900	105,096.00	0.07
87	600351	亚宝药业	17,200	104,404.00	0.07
88	300239	东宝生物	17,600	104,368.00	0.07
89	001387	雪祺电气	7,500	103,050.00	0.07
90	002646	天佑德酒	11,100	103,008.00	0.07
91	605138	盛泰集团	15,300	102,510.00	0.07
92	002083	孚日股份	21,000	101,430.00	0.07
93	301329	信音电子	5,200	101,296.00	0.07
94	000885	城发环境	7,600	101,232.00	0.07
95	301499	维科精密	3,700	100,825.00	0.07
96	600819	耀皮玻璃	17,300	100,686.00	0.07
97	301060	兰卫医学	10,400	100,360.00	0.07
98	603237	五芳斋	6,000	100,260.00	0.07
99	300852	四会富仕	3,100	100,037.00	0.07
100	301529	福赛科技	3,100	97,123.00	0.07
101	600594	益佰制药	23,800	91,630.00	0.06
102	002330	得利斯	19,500	89,310.00	0.06
103	600469	风神股份	15,300	86,445.00	0.06
104	688683	莱尔科技	3,400	85,748.00	0.06
105	301115	联检科技	5,000	77,450.00	0.05
106	300639	凯普生物	13,000	75,400.00	0.05
107	300514	友讯达	5,100	71,808.00	0.05
108	603187	海容冷链	6,100	71,736.00	0.05
109	688025	杰普特	1,000	71,500.00	0.05
110	600052	东望时代	15,300	70,380.00	0.05
111	301337	亚华电子	2,400	70,104.00	0.05

112	002971	和远气体	3,000	69,990.00	0.05
113	603309	维力医疗	5,500	69,960.00	0.05
114	300219	鸿利智汇	10,400	69,888.00	0.05
115	688530	欧莱新材	4,200	69,174.00	0.05
116	300706	阿石创	3,000	69,000.00	0.05
117	688285	高铁电气	8,400	68,880.00	0.05
118	603856	东宏股份	6,000	68,700.00	0.05
119	300909	汇创达	2,600	68,666.00	0.05
120	000978	桂林旅游	11,200	68,656.00	0.05
121	002545	东方铁塔	7,700	68,453.00	0.05
122	600057	厦门象屿	9,700	68,191.00	0.05
123	002787	华源控股	8,300	67,811.00	0.05
124	002322	理工能科	5,604	67,808.40	0.05
125	688468	科美诊断	9,212	67,800.32	0.05
126	603276	恒兴新材	4,100	67,322.00	0.05
127	601211	国泰海通	3,500	67,060.00	0.05
128	688377	迪威尔	2,800	66,836.00	0.05
129	300241	瑞丰光电	11,600	66,120.00	0.04
130	603519	立霸股份	5,400	65,664.00	0.04
131	301345	涛涛车业	600	64,860.00	0.04
132	688668	鼎通科技	1,000	62,460.00	0.04
133	688677	海泰新光	1,600	62,416.00	0.04
134	000937	冀中能源	10,600	60,950.00	0.04
135	002081	金螳螂	17,500	60,025.00	0.04
136	600167	联美控股	10,600	59,572.00	0.04
137	601998	中信银行	7,000	59,500.00	0.04
138	600718	东软集团	6,000	58,500.00	0.04
139	002877	智能自控	6,600	57,750.00	0.04
140	301120	新特电气	5,600	57,344.00	0.04
141	300779	惠城环保	300	53,547.00	0.04
142	300983	尤安设计	2,500	48,800.00	0.03

143	300550	和仁科技	3,500	47,565.00	0.03
144	688432	有研硅	4,200	46,368.00	0.03
145	301419	阿莱德	1,600	44,160.00	0.03
146	002725	跃岭股份	3,300	43,494.00	0.03
147	688317	之江生物	2,333	42,040.66	0.03
148	603206	嘉环科技	2,300	39,514.00	0.03
149	688562	航天软件	2,000	37,480.00	0.03
150	603223	恒通股份	3,500	37,135.00	0.03
151	605399	晨光新材	2,900	37,062.00	0.02
152	002412	汉森制药	5,900	36,698.00	0.02
153	600237	铜峰电子	4,900	35,525.00	0.02
154	002080	中材科技	1,800	35,100.00	0.02
154	001216	华瓷股份	2,600	35,100.00	0.02
155	002790	瑞尔特	4,800	34,896.00	0.02
156	688033	天宜新材	5,400	34,614.00	0.02
157	688589	力合微	1,600	34,224.00	0.02
158	601616	广电电气	8,800	34,056.00	0.02
159	600067	冠城新材	11,300	33,674.00	0.02
160	300365	恒华科技	5,100	33,609.00	0.02
161	600035	楚天高速	7,900	33,496.00	0.02
162	301100	风光股份	1,900	33,098.00	0.02
163	688347	华虹公司	600	32,946.00	0.02
164	300940	南极光	1,300	32,825.00	0.02
165	600488	津药药业	7,800	32,526.00	0.02
166	600015	华夏银行	4,100	32,431.00	0.02
167	002304	洋河股份	500	32,275.00	0.02
168	603012	创力集团	5,800	32,074.00	0.02
169	600268	国电南自	4,100	32,062.00	0.02
170	301088	戎美股份	2,300	31,625.00	0.02
171	603097	江苏华辰	1,400	30,590.00	0.02
172	603528	多伦科技	3,600	30,024.00	0.02

173	300787	海能实业	2,120	29,362.00	0.02
174	603817	海峡环保	5,000	29,100.00	0.02
175	688159	有方科技	400	28,668.00	0.02
176	600908	无锡银行	4,100	25,871.00	0.02
177	300583	赛托生物	1,100	18,964.00	0.01
178	300869	康泰医学	1,300	18,642.00	0.01
179	600517	国网英大	3,600	18,360.00	0.01
180	688768	容知日新	400	17,756.00	0.01
181	603601	再升科技	4,300	17,458.00	0.01
182	000011	深物业A	2,000	16,900.00	0.01
183	001388	信通电子	937	15,385.54	0.01
184	000529	广弘控股	2,400	14,664.00	0.01
185	000596	古井贡酒	100	13,315.00	0.01
186	601916	浙商银行	3,800	12,882.00	0.01
187	301678	新恒汇	281	12,515.74	0.01
188	600654	中安科	3,800	11,286.00	0.01
189	600719	大连热电	1,700	11,016.00	0.01
190	601958	金钼股份	900	9,846.00	0.01
191	300306	远方信息	700	9,044.00	0.01
192	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
193	603382	海阳科技	105	2,350.95	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末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	16,498,991.00	11.12
2	300750	宁德时代	9,537,418.40	6.43
3	601318	中国平安	8,776,373.00	5.92

4	600036	招商银行	7,827,905.00	5.28
5	601166	兴业银行	5,930,958.00	4.00
6	000333	美的集团	5,777,956.00	3.89
7	601899	紫金矿业	5,266,937.00	3.55
8	000651	格力电器	4,823,297.00	3.25
9	600900	长江电力	4,746,062.00	3.20
10	002594	比亚迪	4,610,622.00	3.11
11	601398	工商银行	4,368,619.00	2.94
12	000725	京东方 A	4,029,683.00	2.72
13	600919	江苏银行	3,510,241.00	2.37
14	601328	交通银行	3,501,177.00	2.36
15	601988	中国银行	3,425,618.00	2.31
16	600030	中信证券	3,386,956.00	2.28
17	600000	浦发银行	3,360,847.00	2.27
18	600887	伊利股份	3,277,676.00	2.21
19	601728	中国电信	3,267,650.00	2.20
20	603501	豪威集团	3,241,724.23	2.19
21	002415	海康威视	3,150,469.00	2.12
22	000858	五粮液	3,134,049.00	2.11
23	601601	中国太保	3,086,427.00	2.08
24	000425	徐工机械	2,985,816.00	2.01

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	11,386,686.00	7.68
2	300750	宁德时代	6,441,005.00	4.34
3	601318	中国平安	5,770,463.00	3.89
4	600036	招商银行	5,163,041.00	3.48

5	601166	兴业银行	3,905,120.00	2.63
6	601899	紫金矿业	3,700,458.00	2.49
7	000333	美的集团	3,627,174.00	2.45
8	000651	格力电器	3,477,967.00	2.34
9	002594	比亚迪	3,449,252.00	2.33
10	601398	工商银行	3,250,768.00	2.19
11	601601	中国太保	3,102,790.00	2.09
12	603501	豪威集团	2,964,591.00	2.00
13	300502	新易盛	2,882,502.80	1.94
14	002415	海康威视	2,862,428.00	1.93
15	601988	中国银行	2,851,535.00	1.92
16	600900	长江电力	2,791,877.00	1.88
17	600000	浦发银行	2,785,820.00	1.88
18	601328	交通银行	2,484,206.00	1.67
19	000725	京东方 A	2,459,490.00	1.66
20	600919	江苏银行	2,447,063.00	1.65

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

买入股票成本（成交）总额	607,777,946.43
卖出股票收入（成交）总额	484,854,737.47

注：本项中7.4.1、7.4.2、7.4.3表中的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	-	-
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)	5,700.30	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,700.30	0.00

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	113695	华辰转债	40	4,000.19	0.00
2	123257	安克转债	17	1,700.11	0.00

注：本基金本报告期末仅持有两只债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

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

无。

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

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

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除兴业银行（证券代码：601166）、江苏银行（证券代码：600919）外，其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2024年07月17日，兴业银行（证券代码：601166）发行人兴业银行股份有限公司因未严格按照公布的收费价目名录收费、向小微企业贷款客户转嫁抵押评估费、企业划型管理不到位被国家金融监督管理总局福建监管局处以190万元罚款。

2025年01月24日，江苏银行（证券代码：600919）发行人江苏银行股份有限公司因违反内部控制、人员管理、投资监督、估值核算、信息报送相关规定被中国证券监督管理委员会江苏监管局采取责令改正的行政监督管理措施。

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

7.12.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	163,279.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	163,279.98

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

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

无。

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

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能存在尾差。

§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
泓德 中证A 500指 数增 强A	741	85,565.26	0.00	0.00%	63,403,860.70	100.00%
泓德 中证A 500指 数增 强C	1,142	66,633.81	519,619.98	0.68%	75,576,186.13	99.32%
合计	1,864	74,838.88	519,619.98	0.37%	138,980,046.83	99.63%

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

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情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	泓德中证A500指数增强A	0
	泓德中证A500指数增强C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	泓德中证A500指数增强A	0
	泓德中证A500指数增强C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	泓德中证A500指数增强A	泓德中证A500指数增强C
基金合同生效日(2025年03月11日)基金份额总额	223,494,536.04	253,415,963.66
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	2,523,163.06	10,882,619.14
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	162,613,838.40	188,202,776.69
基金合同生效日起至报告期期末	-	-

基金拆分变动份额		
本报告期末基金份额总额	63,403,860.70	76,095,806.11

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，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

（1）基金管理人的重大人事变动

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

（2）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内,不存在基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,本基金托管人的专门基金托管部门及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
恒泰证券	3	980,746,844.74	89.77%	182,332.00	89.74%	-
国联民生证券	2	111,811,207.60	10.23%	20,850.55	10.26%	-

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
恒泰证券	247.71	100.00%	-	-	-	-	-	-

国联民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
--------	---	---	---	---	---	---	---	---

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

8	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加西南证券股份有限公司为销售机构的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2025-06-27
9	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加腾安基金销售（深圳）有限公司为销售机构的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2025-06-27

§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
无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息
无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

地点为管理人地址：北京市西城区德胜门外大街125号

12.3 查阅方式

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

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

泓德基金管理有限公司
二〇二五年八月二十九日