

泓德中证 A500 指数增强型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 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:2026 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。

基金托管人广发证券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2026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	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
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	12
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）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	68
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	70
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	70
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	70
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	70
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	71
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	71
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	71
7.12 投资组合报告附注	71
§8 基金份额持有人信息	72
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	72
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	73

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.....	73
§9 开放式基金份额变动.....	73
§10 重大事件揭示.....	74
10.1 基金份额持有人大会决议.....	74
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	74
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	74
10.4 基金投资策略的改变	74
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	74
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	74
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	75
10.8 其他重大事件	76
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	77
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.....	77
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	77
§12 备查文件目录.....	77
12.1 备查文件目录	77
12.2 存放地点.....	77
12.3 查阅方式.....	77

§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	102,340,708.78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	49,032,699.63份	53,308,009.15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》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.hongdefund.com
基金中期报告置备地点	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 (2026年01月01日-2026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	6,581,458.33	9,156,338.92
本期利润	8,274,565.69	11,658,590.42
加权平均基金份额本期利润	0.1789	0.1759
本期加权平均净值利润率	13.34%	13.20%
本期基金份额净值增长率	13.82%	13.59%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2026年06月30日)	
期末可供分配利润	18,294,548.01	19,502,047.03
期末可供分配基金份额利润	0.3731	0.3658
期末基金资产净值	70,742,229.77	76,510,060.35
期末基金份额净值	1.4428	1.4352
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2026年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	44.28%	43.52%

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）。

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	①-③	②-④
----	--------------	---------------------	--------------------	----------------------	-----	-----

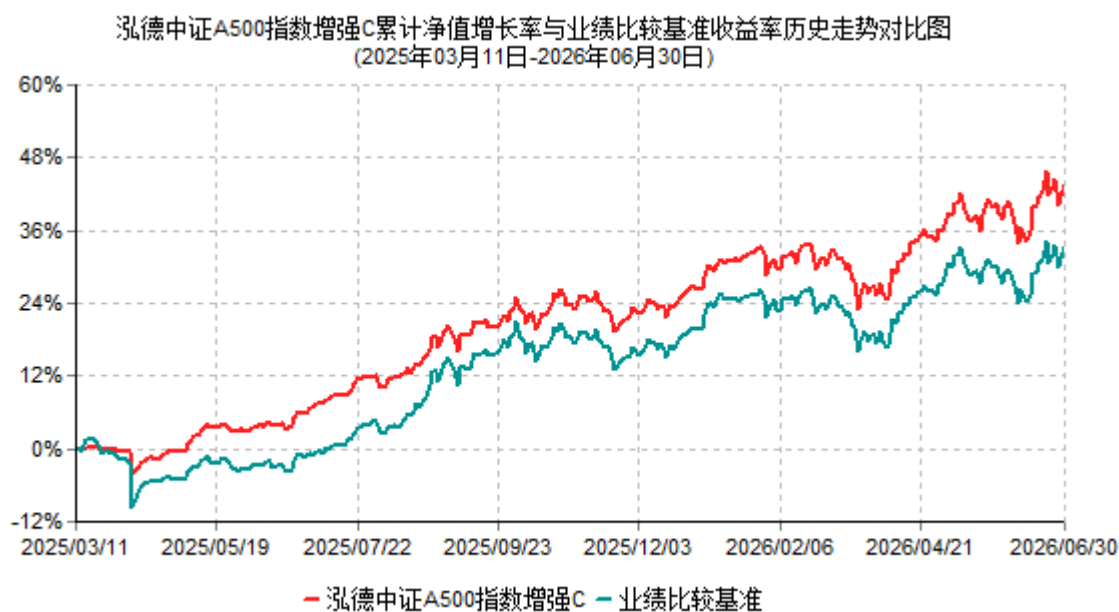
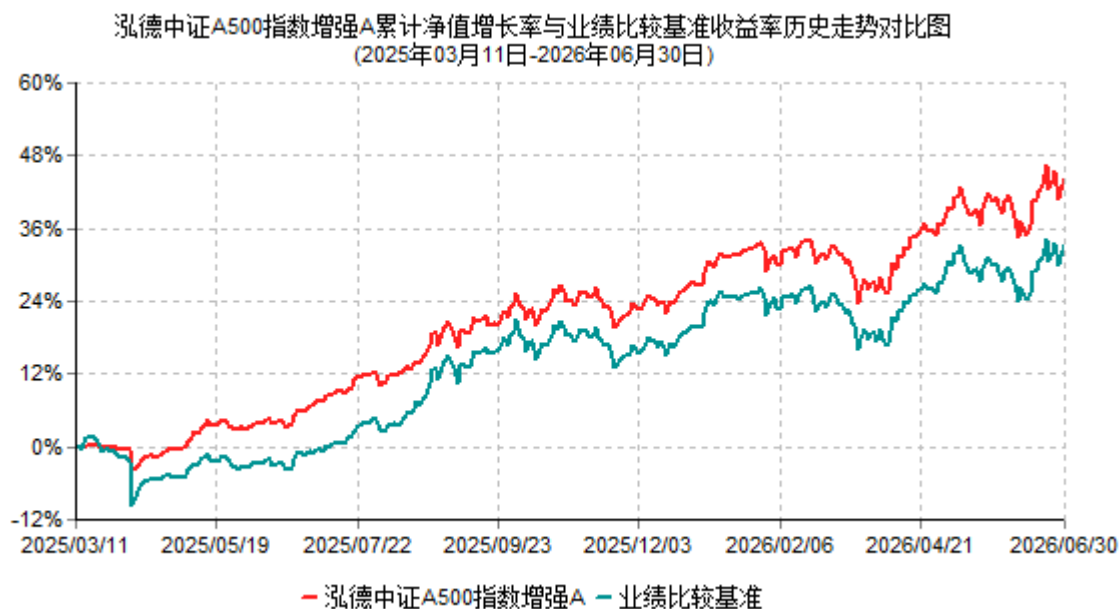
				④		
过去三个月	14.74%	1.35%	13.54%	1.34%	1.20%	0.01%
过去六个月	13.82%	1.22%	11.34%	1.22%	2.48%	0.00%
过去一年	35.58%	1.04%	34.41%	1.09%	1.17%	-0.05%
自基金合同生效起至今	44.28%	0.95%	33.16%	1.08%	11.12%	-0.13%

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
过去三个月	14.62%	1.35%	13.54%	1.34%	1.08%	0.01%
过去六个月	13.59%	1.22%	11.34%	1.22%	2.25%	0.00%
过去一年	35.04%	1.04%	34.41%	1.09%	0.63%	-0.05%
自基金合同生效起至今	43.52%	0.95%	33.16%	1.08%	10.36%	-0.13%

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：根据基金合同的约定，本基金建仓期为6个月，截至报告期末，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	-	12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《证券投资基金经营机构董事、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遵规守信情况的说明

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股主要指数呈现出上涨趋势，但个股出现较大分化，第二季度的科技行情带动了成长股的大幅上涨，同时红利、价值、现金流等风格被持续压制，成长价值的剪刀差被进一步放大。上半年，量化产品的整体超额波动较大，快速的风格切换和极致的一九行情给量化策略带来了较多困难，我们在策略上选择了均衡配置，没有在市值和成长上做过多暴露，超额收益经历了年初的小幅回撤后总体表现稳健。

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1.4428元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为13.82%，同期业绩比较基准收益率为11.34%；截至报告期末泓德中证A500指数增强C基金份额净值为1.4352元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为13.59%，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

7月以来,市场再次出现大幅反转,受Meta出售算力消息刺激和韩国市场大跌影响,电子、通信等热门板块出现显著回调,红利类资产触底反弹,同时也引发了市场对于AI泡沫和科技股牛市终结的讨论。从已实现的AI编程到未来的具身智能, AI技术依然在快速发展,当然技术的进步也不是一蹴而就的,二级市场受资金面和流动性影响总会产生或大或小的波动并呈现出一定的周期性,我们应该理性去看待这种波动。宏观方面,上半年GDP同比增长4.7%,符合全年GDP增长目标区间,但内需压力较大,二季度,投资大幅下滑,地产投资依旧拖累较大,消费明显回落,只有出口依旧保持韧性。与宏观经济总体平稳形成对比的是微观体感的差异,大家感受到的是居民就业的压力、收入的压力,企业订单的压力,但背后反映的是我国经济新旧动能的转换,以高端制造、数字经济、现代服务为代表的新动能对经济增长的贡献率超过了4成。聚焦在产品上,我们希望持续开发多元化的Alpha策略,努力适应较为多变的市场环境,力争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2026年06月30日，期末可供分配利润为37,796,595.04元，其中：泓德中证A500指数增强A期末可供分配利润为18,294,548.01元（泓德中证A500指数增强A的未分配利润已实现部分为18,294,548.01元，未分配利润未实现部分为3,414,982.13元），泓德中证A500指数增强C期末可供分配利润为19,502,047.03元（泓德中证A500指数增强C的未分配利润已实现部分为19,502,047.03元，未分配利润未实现部分为3,700,004.17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2026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：2026年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末	上年度末
-----	-----	-----	------

		2026年06月30日	2025年12月31日
资 产:			
货币资金	6.4.7.1	13,011,207.72	12,951,964.31
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	135,688,910.25	151,666,440.01
其中：股票投资		135,685,764.21	151,621,972.31
基金投资		-	-
债券投资		3,146.04	44,467.70
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		346,625.64	17,790,271.44
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		149,046,743.61	182,408,675.76
负债和净资产	附注号	本期末 2026年06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		-	-
应付赎回款		1,579,243.26	3,104,664.24
应付管理人报酬		91,284.17	101,612.59

应付托管费		17,115.78	19,052.36
应付销售服务费		25,589.95	31,050.82
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	81,220.33	140,948.00
负债合计		1,794,453.49	3,397,328.01
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	102,340,708.78	141,503,097.37
未分配利润	6.4.7.8	44,911,581.34	37,508,250.38
净资产合计		147,252,290.12	179,011,347.75
负债和净资产总计		149,046,743.61	182,408,675.76

注：报告截止日2026年06月30日，基金份额总额102,340,708.78份，其中A类基金份额总额为49,032,699.63份，基金份额净值为1.4428元；C类基金份额总额为53,308,009.15份，基金份额净值为1.4352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：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 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		20,908,036.35	16,237,973.33
1.利息收入		57,621.27	529,079.19
其中：存款利息收入	6.4.7.9	57,621.27	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）		16,617,330.94	11,920,975.85
其中：股票投资收益	6.4.7.10	15,401,503.15	9,481,551.77
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	27,389.04	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	1,188,438.75	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	4,195,358.86	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	37,725.28	1,541.25
减：二、营业总支出		974,880.24	1,200,938.17
1.管理人报酬		598,228.07	791,522.29
2.托管费		112,167.84	148,410.51
3.销售服务费		175,933.05	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	88,551.28	52,973.76
三、利润总额（亏损总额		19,933,156.11	15,037,035.16

以“-”号填列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列)		19,933,156.11	15,037,035.16
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		19,933,156.11	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：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2026年01月01日至2026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	141,503,097.37	37,508,250.38	179,011,347.75
二、本期期初净资产	141,503,097.37	37,508,250.38	179,011,347.75
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列)	-39,162,388.59	7,403,330.96	-31,759,057.63
（一）、综合收益总额	-	19,933,156.11	19,933,156.11
（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)	-39,162,388.59	-12,529,825.15	-51,692,213.74
其中：1.基金申购款	62,716,562.98	21,464,553.29	84,181,116.27
2.基金赎回款	-101,878,951.57	-33,994,378.44	-135,873,330.01

（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	102,340,708.78	44,911,581.34	147,252,290.12
项 目	上年度可比期间 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

产			
---	--	--	--

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》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第2号-定期报告的内容与格式》、《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》,以及中国证券投资基金业协会颁布的《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》和中国证监会、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2026年1月1日至2026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2026年6月30日的财务状况以及2026年1月1日至2026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 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

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令826号文《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告2026年第10号文《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；自2026年1月1日至2027年12月31日，对公募证券投资基金（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、债券取得的收入免征增值税；自2026年1月1日至2027年12月31日，金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局公告2025年第4号文《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自2025年8月8日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在2025年8月8日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期；

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》及财政部、税务总局公告2026年第10号文《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，自2026年1月1日至2027年12月31日，资管产品管理人运营契约制资管产品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，资管产品管理人未分别核算运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下称资管产品运营业务）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；

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 2026年06月30日
活期存款	10,164,720.46
等于：本金	10,161,783.16

加：应计利息	2,937.30
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	2,846,487.26
等于：本金	2,846,419.68
加：应计利息	67.58
减：坏账准备	-
合计	13,011,207.72

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 2026年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		122,432,908.21	-	135,685,764.21	13,252,856.00
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	2,000.00	0.24	3,146.04	1,145.80
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	2,000.00	0.24	3,146.04	1,145.80
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		122,434,908.21	0.24	135,688,910.25	13,254,001.80

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 2026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	78,351.28
其他应付款	2,869.05
合计	81,220.33

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	本期
----	----

(泓德中证A500指数增强A)	2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	52,856,626.21	52,856,626.21
本期申购	18,347,470.82	18,347,470.82
本期赎回（以“-”号填列）	-22,171,397.40	-22,171,397.40
本期末	49,032,699.63	49,032,699.63

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 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	88,646,471.16	88,646,471.16
本期申购	44,369,092.16	44,369,092.16
本期赎回（以“-”号填列）	-79,707,554.17	-79,707,554.17
本期末	53,308,009.15	53,308,009.15

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

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	12,318,569.26	1,827,681.40	14,146,250.66
本期期初	12,318,569.26	1,827,681.40	14,146,250.66
本期利润	6,581,458.33	1,693,107.36	8,274,565.69
本期基金份额交易产生的变动数	-605,479.58	-105,806.63	-711,286.21
其中：基金申购款	6,185,128.93	811,457.21	6,996,586.14
基金赎回款	-6,790,608.51	-917,263.84	-7,707,872.35
本期已分配利润	-	-	-

本期末	18,294,548.01	3,414,982.13	21,709,530.14
-----	---------------	--------------	---------------

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	20,300,437.16	3,061,562.56	23,361,999.72
本期期初	20,300,437.16	3,061,562.56	23,361,999.72
本期利润	9,156,338.92	2,502,251.50	11,658,590.42
本期基金份额交易产生的变动数	-9,954,729.05	-1,863,809.89	-11,818,538.94
其中：基金申购款	12,903,563.19	1,564,403.96	14,467,967.15
基金赎回款	-22,858,292.24	-3,428,213.85	-26,286,506.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	19,502,047.03	3,700,004.17	23,202,051.20

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
活期存款利息收入	55,634.81
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,986.46
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	57,621.27

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 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出股票成交总额	340,114,639.28
减：卖出股票成本总额	324,382,135.53
减：交易费用	331,000.60
买卖股票差价收入	15,401,503.15

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01月01日至2026年06月30日
债券投资收益——利息收入	11.51
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	27,377.53
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	27,389.04

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01月01日至2026年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	81,201.14
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	53,800.00
减：应计利息总额	20.37
减：交易费用	3.24
买卖债券差价收入	27,377.53

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 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,188,438.75
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,188,438.75

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
1.交易性金融资产	4,195,358.86
——股票投资	4,209,171.66
——债券投资	-13,812.80
——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	4,195,358.86

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
基金赎回费收入	37,719.99
基金转换费收入	5.29
合计	37,725.28

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
审计费用	18,843.91
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	9,000.00
开户费	1,200.00
合计	88,551.28

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

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 2026年01月01日 至2026年06月30 日	上年度可比期间 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	598,228.07	791,522.29
其中：应支付销售机构的客户维护费	243,340.78	385,952.76
应支付基金管理人的净管理费	354,887.29	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 2026年01月01日 至2026年06月30 日	上年度可比期间 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	112,167.84	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		
	2026年01月01日至2026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	26,528.25	26,528.25
泓德基金	0.00	7.49	7.49
合计	0.00	26,535.74	26,535.74
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间		
	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	本期	上年度可比期间
------	----	---------

称	2026年01月01日至2026年06月30日		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	期末余额	当期利息收入
广发证券	10,164,720.46	55,634.81	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（2026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
301666	大普微	2026-04-08	6个月以上	限售股	46.08	463.33	236	10,874.88	109,345.88	-
688808	联讯仪器	2026-04-16	6个月以上	限售股	81.88	1,584.33	38	3,111.44	60,204.54	-
001248	华润新能源	2026-06-24	6个月以上	新股未上市且限售	10.11	10.11	4,317	43,644.87	43,644.87	-

688818	电科蓝天	2026-02-03	6个月以上	限售股	9.47	70.14	488	4,621.36	34,228.32	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6个月以上	限售股	19.68	141.49	239	4,703.52	33,816.11	-
301682	宏明电子	2026-03-18	6个月以上	限售股	69.66	160.06	141	9,822.06	22,568.46	-
688635	长进光子	2026-05-20	6个月以上	限售股	40.98	308.19	67	2,745.66	20,648.73	-
688785	恒运昌	2026-01-20	6个月以上	限售股	92.18	463.15	44	4,055.92	20,378.60	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6个月以上	限售股	26.28	172.09	115	3,022.20	19,790.35	-
001248	华润新能源	2026-06-24	6个交易日	新股未上市	10.11	10.11	1,850	18,703.50	18,703.50	-
688781	视涯科技	2026-03-18	6个月以上	限售股	22.68	47.61	293	6,645.24	13,949.73	-
001257	盛龙股份	2026-03-24	6个月以上	限售股	7.82	20.74	627	4,903.14	13,003.98	-
301531	春光集团	2026-04-28	6个月以上	限售股	13.30	51.56	180	2,394.00	9,280.80	-
301696	三瑞智能	2026-03-31	6个月以上	限售股	24.68	86.80	97	2,393.96	8,419.60	-

603407	长裕集团	2026-04-29	6个月以上	限售股	13.86	73.46	104	1,441.44	7,639.84	-
301599	理奇智能	2026-04-22	6个月以上	限售股	13.91	32.47	191	2,656.81	6,201.77	-
301680	固德电材	2026-02-27	6个月以上	限售股	58.00	112.16	52	3,016.00	5,832.32	-
301513	尚水智能	2026-04-10	6个月以上	限售股	26.66	50.96	101	2,692.66	5,146.96	-
001365	天海电子	2026-05-11	6个月以上	限售股	27.19	31.31	164	4,459.16	5,134.84	-
001393	维通利	2026-05-08	6个月以上	限售股	30.38	38.99	114	3,463.32	4,444.86	-
688816	易思维	2026-02-04	6个月以上	限售股	55.95	57.10	69	3,860.55	3,939.90	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6个月以上	限售股	17.52	35.92	108	1,892.16	3,879.36	-
001237	惠康科技	2026-05-15	6个月以上	限售股	53.26	58.74	65	3,461.90	3,818.10	-
601112	振石股份	2026-01-21	6个月以上	限售股	11.18	17.59	159	1,777.62	2,796.81	-
603352	至信股份	2026-01-08	6个月以上	限售股	21.88	25.52	52	1,137.76	1,327.04	-

001220	世盟股份	2026-01-27	6个月以上	限售股	28.00	27.78	44	1,232.00	1,222.32	-
603284	林平发展	2026-02-03	6个月以上	限售股	37.88	34.87	33	1,250.04	1,150.71	-
001312	福恩股份	2026-04-14	6个月以上	限售股	18.38	16.78	57	1,047.66	956.46	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6个月以上	限售股	33.49	33.93	28	937.72	950.04	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票/债券账户，选择网上或者网下一种方式进行新股/新债申购。基金参与申购获配的新股/新债，从新股/新债获配日至新股/新债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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026-06-29	重大事项	832.00	2026-07-13	890.99	200	86,416.33	166,400.00	-

注：本基金截至2026年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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0.00%(上年度末：0.02%)。

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 2026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	13,011,207.72	-	-	-	13,011,207.72
交易性 金融资产	-	-	3,146.04	135,685,764.21	135,688,910.25
应收申 购款	-	-	-	346,625.64	346,625.64
资产总 计	13,011,207.72	-	3,146.04	136,032,389.85	149,046,743.61
负债					
应付赎 回款	-	-	-	1,579,243.26	1,579,243.26
应付管 理人报 酬	-	-	-	91,284.17	91,284.17
应付托 管费	-	-	-	17,115.78	17,115.78
应付销 售服务 费	-	-	-	25,589.95	25,589.95
其他负 债	-	-	-	81,220.33	81,220.33
负债总 计	-	-	-	1,794,453.49	1,794,453.49
利率敏 感度缺 口	13,011,207.72	-	3,146.04	134,237,936.36	147,252,290.12
上年度 末	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

2025年 12月31 日					
资产					
货币资金	12,951,964.31	-	-	-	12,951,964.31
交易性金融资产	-	-	44,467.70	151,621,972.31	151,666,440.01
应收申购款	-	-	-	17,790,271.44	17,790,271.44
资产总计	12,951,964.31	-	44,467.70	169,412,243.75	182,408,675.76
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,104,664.24	3,104,664.24
应付管理人报酬	-	-	-	101,612.59	101,612.59
应付托管费	-	-	-	19,052.36	19,052.36
应付销售服务费	-	-	-	31,050.82	31,050.82
其他负债	-	-	-	140,948.00	140,948.00
负债总计	-	-	-	3,397,328.01	3,397,328.01
利率敏感度缺口	12,951,964.31	-	44,467.70	166,014,915.74	179,011,347.75

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（不包括可转债和可交换债）公允价值占基金资产净值的比例为0%(上年度末：0%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(上年度末：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市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 2026年06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	135,685,764.21	92.15	151,621,972.31	84.70
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	3,146.04	-	44,467.70	0.02
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	135,688,910.25	92.15	151,666,440.01	84.72

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化5%，其他变量不变		
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06月30日	上年度末 2025年12月31日
	业绩比较基准上升5%	7,305,434.29	-
	业绩比较基准下降5%	-7,305,434.29	-

注：于上年度末，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 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	135,040,085.45	150,495,454.87
第二层次	228,748.37	904,565.74
第三层次	420,076.43	266,419.40
合计	135,688,910.25	151,666,440.01

6.4.14.2 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	135,685,764.21	91.04
	其中：股票	135,685,764.21	91.04
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,146.04	0.00
	其中：债券	3,146.04	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	13,011,207.72	8.73
8	其他各项资产	346,625.64	0.23
9	合计	149,046,743.61	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	17,495.00	0.01
B	采矿业	6,951,010.00	4.72
C	制造业	80,809,420.21	54.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,510,394.00	1.03
E	建筑业	600,033.00	0.41
F	批发和零售业	1,211,481.00	0.82
G	交通运输、仓储和邮政业	2,354,320.00	1.60
H	住宿和餐饮业	36,428.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,831,825.00	3.96
J	金融业	11,118,839.00	7.55
K	房地产业	497,952.00	0.34
L	租赁和商务服务业	775,098.00	0.53
M	科学研究和技术服务业	2,409,678.00	1.64
N	水利、环境和公共设施管理业	744,377.20	0.51
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	32,695.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	129,916.00	0.09

S	综合	97,382.00	0.07
	合计	115,128,343.41	78.18

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	336,191.00	0.23
B	采矿业	428,214.98	0.29
C	制造业	14,837,768.13	10.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	448,587.37	0.30
E	建筑业	20,753.00	0.01
F	批发和零售业	715,690.00	0.49
G	交通运输、仓储和邮政业	192,582.32	0.13
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,596,648.00	1.08
J	金融业	855,050.00	0.58
K	房地产业	88,935.00	0.06
L	租赁和商务服务业	192,040.00	0.13
M	科学研究和技术服务业	292,940.00	0.20
N	水利、环境和公共设施管理业	49,887.00	0.03
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	502,134.00	0.34
S	综合	-	-
	合计	20,557,420.80	13.96

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	300308	中际旭创	6,700	8,509,000.00	5.78
2	300502	新易盛	7,960	4,831,720.00	3.28
3	300750	宁德时代	10,200	4,008,702.00	2.72
4	688256	寒武纪	1,792	2,859,225.60	1.94
5	601899	紫金矿业	105,000	2,639,700.00	1.79
6	600519	贵州茅台	2,000	2,370,980.00	1.61
7	603986	兆易创新	2,900	2,363,500.00	1.61
8	688012	中微公司	3,984	1,866,504.00	1.27
9	601318	中国平安	38,500	1,837,990.00	1.25
10	603259	药明康德	14,200	1,768,042.00	1.20
11	002371	北方华创	1,870	1,654,127.20	1.12
12	002384	东山精密	6,100	1,600,335.00	1.09
13	600183	生益科技	9,000	1,560,600.00	1.06
14	600150	中国船舶	40,600	1,371,874.00	0.93
15	600030	中信证券	47,600	1,367,548.00	0.93
16	000725	京东方 A	155,800	1,352,344.00	0.92
17	300274	阳光电源	8,300	1,319,866.00	0.90
18	002475	立讯精密	18,700	1,316,480.00	0.89
19	600036	招商银行	33,400	1,185,700.00	0.81
20	300408	三环集团	7,100	1,184,990.00	0.80
21	688041	海光信息	3,200	1,184,960.00	0.80
22	688008	澜起科技	3,800	1,177,620.00	0.80
23	000333	美的集团	15,300	1,155,609.00	0.78
24	600487	亨通光电	9,700	1,060,598.00	0.72
25	601398	工商银行	147,700	1,044,239.00	0.71
26	601166	兴业银行	62,400	1,033,344.00	0.70

27	002463	沪电股份	6,700	1,023,760.00	0.70
28	300476	胜宏科技	2,800	970,004.00	0.66
29	300604	长川科技	2,700	921,834.00	0.63
30	688002	睿创微纳	5,682	878,948.58	0.60
31	300394	天孚通信	2,880	871,718.40	0.59
32	603993	洛阳钼业	49,400	866,970.00	0.59
33	688981	中芯国际	5,402	857,945.64	0.58
34	600176	中国巨石	11,600	845,408.00	0.57
35	300059	东方财富	40,100	817,238.00	0.55
36	000938	紫光股份	27,100	782,106.00	0.53
37	002415	海康威视	22,800	779,760.00	0.53
38	600900	长江电力	29,200	772,924.00	0.52
39	688498	源杰科技	400	754,400.00	0.51
40	600887	伊利股份	30,700	735,572.00	0.50
41	000792	盐湖股份	22,200	670,218.00	0.46
42	300475	香农芯创	2,200	660,000.00	0.45
43	300054	鼎龙股份	6,200	657,014.00	0.45
44	002266	浙富控股	119,400	604,164.00	0.41
45	601600	中国铝业	71,800	590,196.00	0.40
46	300033	同花顺	2,420	583,220.00	0.40
47	601211	国泰海通	31,400	571,480.00	0.39
48	000100	TCL科技	97,200	565,704.00	0.38
49	300857	协创数据	1,600	543,840.00	0.37
50	000988	华工科技	2,900	535,369.00	0.36
51	600346	恒力石化	30,000	531,300.00	0.36
52	000651	格力电器	14,100	528,750.00	0.36
53	000426	兴业银锡	16,000	527,360.00	0.36
54	600549	厦门钨业	6,100	519,720.00	0.35
55	688521	芯原股份	1,400	519,596.00	0.35
56	600885	宏发股份	14,780	509,762.20	0.35
57	002027	分众传媒	105,200	509,168.00	0.35

58	002493	荣盛石化	46,600	500,950.00	0.34
59	300223	北京君正	2,000	497,800.00	0.34
60	002008	大族激光	3,300	495,363.00	0.34
61	688525	佰维存储	1,000	494,730.00	0.34
62	600989	宝丰能源	24,300	494,019.00	0.34
63	301358	湖南裕能	6,400	485,568.00	0.33
64	600941	中国移动	5,400	465,102.00	0.32
65	000408	藏格矿业	6,700	464,444.00	0.32
66	600522	中天科技	7,600	461,168.00	0.31
67	688396	华润微	4,600	448,730.00	0.30
68	002120	韵达股份	70,400	447,744.00	0.30
69	000975	山金国际	26,100	443,700.00	0.30
70	601288	农业银行	72,500	440,075.00	0.30
71	603019	中科曙光	4,100	439,643.00	0.30
72	002558	巨人网络	15,900	438,204.00	0.30
73	603799	华友钴业	8,700	419,862.00	0.29
74	300014	亿纬锂能	6,400	416,192.00	0.28
75	000807	云铝股份	18,700	414,018.00	0.28
76	000001	平安银行	40,800	410,040.00	0.28
77	600547	山东黄金	17,400	401,766.00	0.27
78	601225	陕西煤业	19,700	400,895.00	0.27
79	002028	思源电气	2,300	397,900.00	0.27
80	000338	潍柴动力	14,600	397,850.00	0.27
81	300803	指南针	4,300	394,181.00	0.27
82	688390	固德威	3,600	390,636.00	0.27
83	605117	德业股份	3,640	386,495.20	0.26
84	600938	中国海油	13,600	369,240.00	0.25
85	300433	蓝思科技	6,800	364,888.00	0.25
86	002709	天赐材料	6,900	354,867.00	0.24
87	002128	电投能源	15,300	353,736.00	0.24
88	000933	神火股份	16,600	351,920.00	0.24

89	600026	中远海能	19,400	348,036.00	0.24
90	688111	金山办公	1,600	340,880.00	0.23
91	600000	浦发银行	39,300	338,373.00	0.23
92	300124	汇川技术	4,900	325,017.00	0.22
93	688036	传音控股	5,400	318,330.00	0.22
94	601816	京沪高铁	69,400	314,382.00	0.21
95	300972	万辰集团	1,800	312,138.00	0.21
96	002281	光迅科技	1,200	308,328.00	0.21
97	300458	全志科技	7,800	307,788.00	0.21
98	601628	中国人寿	8,500	300,475.00	0.20
99	300438	鹏辉能源	3,600	298,260.00	0.20
100	600482	中国动力	9,000	295,200.00	0.20
101	603501	豪威集团	3,100	294,035.00	0.20
102	600276	恒瑞医药	5,600	291,424.00	0.20
103	601988	中国银行	50,600	289,432.00	0.20
104	300012	华测检测	20,700	286,902.00	0.19
105	600489	中金黄金	15,700	283,385.00	0.19
106	002414	高德红外	21,100	279,786.00	0.19
107	601766	中国中车	52,300	271,960.00	0.18
108	688472	阿特斯	24,600	266,172.00	0.18
109	600535	天士力	20,000	264,600.00	0.18
110	688188	柏楚电子	2,472	263,762.40	0.18
111	000538	云南白药	5,400	255,798.00	0.17
112	600309	万华化学	3,700	253,117.00	0.17
113	002594	比亚迪	3,100	247,070.00	0.17
114	600011	华能国际	32,300	245,157.00	0.17
115	300347	泰格医药	5,100	244,800.00	0.17
116	601601	中国太保	8,500	242,420.00	0.16
117	600019	宝钢股份	44,600	242,178.00	0.16
118	300782	卓胜微	2,200	241,076.00	0.16
119	600426	华鲁恒升	9,900	236,808.00	0.16

120	002273	水晶光电	6,600	234,168.00	0.16
121	002532	天山铝业	21,500	230,695.00	0.16
122	002648	卫星化学	9,800	230,202.00	0.16
123	300573	兴齐眼药	5,535	225,606.60	0.15
124	600418	江淮汽车	8,700	224,721.00	0.15
125	601360	三六零	25,300	219,857.00	0.15
126	600066	宇通客车	8,200	219,842.00	0.15
127	601872	招商轮船	12,400	217,868.00	0.15
128	000519	中兵红箭	10,300	217,021.00	0.15
129	600104	上汽集团	22,100	215,696.00	0.15
130	603288	海天味业	6,300	208,908.00	0.14
131	601328	交通银行	32,400	208,332.00	0.14
132	688223	晶科能源	43,600	207,100.00	0.14
133	600039	四川路桥	25,600	200,192.00	0.14
134	600660	福耀玻璃	3,900	196,716.00	0.13
135	600009	上海机场	8,500	196,350.00	0.13
136	603766	隆鑫通用	16,400	195,652.00	0.13
137	603392	万泰生物	7,200	194,184.00	0.13
138	600663	陆家嘴	30,800	193,424.00	0.13
139	688120	华海清科	600	193,308.00	0.13
140	600886	国投电力	14,500	192,995.00	0.13
141	600029	南方航空	37,200	192,696.00	0.13
142	301550	斯菱智驱	2,100	192,003.00	0.13
143	002916	深南电路	410	187,739.00	0.13
144	600219	南山铝业	47,000	187,530.00	0.13
145	300757	罗博特科	300	185,700.00	0.13
146	601567	三星电气	12,400	185,256.00	0.13
147	601233	桐昆股份	8,300	179,695.00	0.12
148	002130	沃尔核材	9,400	178,224.00	0.12
149	000830	鲁西化工	14,800	177,600.00	0.12
150	002155	湖南黄金	7,400	176,638.00	0.12

151	600031	三一重工	10,200	176,256.00	0.12
152	002202	金风科技	7,300	174,470.00	0.12
153	002460	赣锋锂业	2,600	170,040.00	0.12
154	601058	赛轮轮胎	14,700	169,491.00	0.12
155	601668	中国建筑	38,600	167,524.00	0.11
156	688072	拓荆科技	200	166,400.00	0.11
157	601117	中国化学	22,300	163,905.00	0.11
158	000967	盈峰环境	15,400	162,162.00	0.11
159	002049	紫光国微	1,800	159,750.00	0.11
160	601127	赛力斯	2,600	159,250.00	0.11
161	002497	雅化集团	7,700	156,849.00	0.11
162	300866	安克创新	1,500	156,750.00	0.11
163	300724	捷佳伟创	2,200	155,320.00	0.11
164	600160	巨化股份	2,900	153,729.00	0.10
165	002466	天齐锂业	2,500	153,300.00	0.10
166	600028	中国石化	34,300	152,978.00	0.10
167	000733	振华科技	2,700	152,928.00	0.10
168	600362	江西铜业	3,500	151,550.00	0.10
169	300442	润泽科技	1,800	149,526.00	0.10
170	300760	迈瑞医疗	1,100	149,413.00	0.10
171	601877	正泰电器	5,900	147,913.00	0.10
172	300395	菲利华	1,100	147,103.00	0.10
173	002156	通富微电	1,900	144,153.00	0.10
174	601857	中国石油	16,600	144,088.00	0.10
175	600141	兴发集团	3,000	140,910.00	0.10
176	600585	海螺水泥	8,300	140,685.00	0.10
177	000423	东阿阿胶	3,000	136,080.00	0.09
178	000625	长安汽车	18,100	129,777.00	0.09
179	600765	中航重机	10,000	129,200.00	0.09
180	003816	中国广核	32,400	126,684.00	0.09
181	601018	宁波港	39,500	124,425.00	0.08

182	600436	片仔癀	1,100	120,208.00	0.08
183	601000	唐山港	28,700	119,105.00	0.08
184	001965	招商公路	13,000	119,080.00	0.08
185	601689	拓普集团	2,100	118,482.00	0.08
186	600323	瀚蓝环境	4,100	112,586.00	0.08
187	300017	网宿科技	8,500	110,585.00	0.08
188	300759	康龙化成	3,800	109,934.00	0.07
189	688009	中国通号	23,076	109,841.76	0.07
190	688578	艾力斯	1,000	109,200.00	0.07
191	600008	首创环保	40,100	109,072.00	0.07
192	600988	赤峰黄金	4,100	107,912.00	0.07
193	000977	浪潮信息	1,500	105,000.00	0.07
194	600515	海南机场	37,900	103,846.00	0.07
195	300251	光线传媒	9,200	102,028.00	0.07
196	600673	东阳光	2,900	97,382.00	0.07
197	601238	广汽集团	18,900	96,012.00	0.07
198	002138	顺络电子	1,300	95,030.00	0.06
199	300001	特锐德	2,500	94,575.00	0.06
200	601607	上海医药	6,100	93,940.00	0.06
201	600038	中直股份	3,700	93,573.00	0.06
202	002837	英维克	1,140	90,698.40	0.06
203	600089	特变电工	4,000	90,000.00	0.06
204	603659	璞泰来	3,100	89,683.00	0.06
205	600018	上港集团	18,700	88,264.00	0.06
206	300751	迈为股份	300	84,738.00	0.06
207	000301	东方盛虹	7,300	83,585.00	0.06
208	603816	顾家家居	3,700	82,732.00	0.06
209	603979	金诚信	1,400	82,642.00	0.06
210	600048	保利发展	17,500	81,025.00	0.06
211	600741	华域汽车	5,200	80,704.00	0.05
212	600153	建发股份	9,900	78,507.00	0.05

213	300058	蓝色光标	5,600	77,056.00	0.05
214	600655	豫园股份	18,500	76,035.00	0.05
215	300136	信维通信	600	71,550.00	0.05
216	002544	普天科技	3,900	71,058.00	0.05
217	301308	江波龙	100	70,380.00	0.05
218	002271	东方雨虹	5,900	70,033.00	0.05
219	688266	泽璟制药	600	69,996.00	0.05
220	605499	东鹏饮料	550	67,886.50	0.05
221	600570	恒生电子	3,200	67,808.00	0.05
222	300073	当升科技	1,400	67,256.00	0.05
223	002074	国轩高科	2,400	66,024.00	0.04
224	600208	衢州发展	23,200	65,656.00	0.04
225	600415	小商品城	6,400	65,024.00	0.04
226	300142	沃森生物	5,000	64,950.00	0.04
227	600233	圆通速递	4,000	63,000.00	0.04
228	601179	中国西电	4,100	61,172.00	0.04
229	688506	百利天恒	200	58,806.00	0.04
230	002555	三七互娱	3,000	56,610.00	0.04
231	300699	光威复材	1,900	54,435.00	0.04
232	002938	鹏鼎控股	500	52,690.00	0.04
233	600795	国电电力	11,100	51,837.00	0.04
234	600839	四川长虹	7,300	50,954.00	0.03
235	688235	百济神州	200	50,922.00	0.03
236	688777	中控技术	400	47,000.00	0.03
237	601919	中远海控	3,500	46,410.00	0.03
238	601021	春秋航空	1,000	45,580.00	0.03
239	603087	甘李药业	800	45,408.00	0.03
240	002080	中材科技	500	45,000.00	0.03
241	000858	五粮液	600	44,400.00	0.03
242	600177	雅戈尔	5,800	43,674.00	0.03
243	601888	中国中免	800	42,968.00	0.03

244	688213	思特威	400	42,828.00	0.03
245	688099	晶晨股份	400	41,160.00	0.03
246	002436	兴森科技	800	40,760.00	0.03
247	600050	中国联通	10,000	40,000.00	0.03
248	688126	沪硅产业	1,000	39,890.00	0.03
249	603596	伯特利	1,584	39,346.56	0.03
250	603650	彤程新材	400	39,192.00	0.03
251	600372	中航机载	3,600	39,060.00	0.03
252	300454	深信服	400	38,480.00	0.03
253	600460	士兰微	700	38,262.00	0.03
254	300037	新宙邦	400	37,140.00	0.03
255	002179	中航光电	800	36,960.00	0.03
256	688617	惠泰医疗	200	36,312.00	0.02
257	600699	均胜电子	1,600	34,576.00	0.02
258	688180	君实生物	1,000	33,820.00	0.02
259	000630	铜陵有色	5,300	33,708.00	0.02
260	601658	邮储银行	6,800	33,524.00	0.02
261	688608	恒玄科技	200	33,438.00	0.02
262	000831	中国稀土	600	33,294.00	0.02
263	601728	中国电信	6,300	32,697.00	0.02
264	002044	美年健康	6,500	32,695.00	0.02
265	002244	滨江集团	4,200	31,920.00	0.02
266	601390	中国中铁	7,600	31,692.00	0.02
267	601633	长城汽车	2,100	31,689.00	0.02
268	002236	大华股份	1,900	31,331.00	0.02
269	002318	久立特材	1,300	31,070.00	0.02
270	600754	锦江酒店	1,600	28,784.00	0.02
271	300661	圣邦股份	200	28,696.00	0.02
272	000157	中联重科	4,100	28,577.00	0.02
273	600690	海尔智家	1,400	28,574.00	0.02
274	002831	裕同科技	800	28,448.00	0.02

275	600166	福田汽车	9,700	28,227.00	0.02
276	300144	宋城演艺	4,800	27,888.00	0.02
277	600143	金发科技	1,800	27,810.00	0.02
278	300919	中伟新材	600	26,250.00	0.02
279	601012	隆基绿能	2,000	26,240.00	0.02
280	000963	华东医药	900	25,308.00	0.02
281	600118	中国卫星	300	24,615.00	0.02
282	601186	中国铁建	4,100	24,395.00	0.02
283	002738	中矿资源	400	23,596.00	0.02
284	600998	九州通	5,000	23,450.00	0.02
285	688469	芯联集成	2,200	23,342.00	0.02
286	002595	豪迈科技	500	23,300.00	0.02
287	600312	平高电气	1,300	22,958.00	0.02
288	688063	派能科技	400	21,308.00	0.01
289	002252	上海莱士	4,900	21,266.00	0.01
290	600816	建元信托	8,700	21,228.00	0.01
291	002517	恺英网络	1,300	21,125.00	0.01
292	688166	博瑞医药	600	21,006.00	0.01
293	603568	伟明环保	1,340	20,609.20	0.01
294	603486	科沃斯	400	20,300.00	0.01
295	000657	中钨高新	200	19,144.00	0.01
296	000878	云南铜业	1,200	19,056.00	0.01
297	600004	白云机场	2,600	18,876.00	0.01
298	601799	星宇股份	200	18,124.00	0.01
299	300432	富临精工	900	18,081.00	0.01
300	600196	复星医药	800	17,976.00	0.01
301	002714	牧原股份	500	17,495.00	0.01
302	300601	康泰生物	1,500	17,010.00	0.01
303	601727	上海电气	2,400	16,800.00	0.01
304	000039	中集集团	2,000	16,220.00	0.01
305	688122	西部超导	257	16,142.17	0.01

306	001979	招商蛇口	2,500	16,075.00	0.01
307	002025	航天电器	200	15,244.00	0.01
308	603939	益丰药房	700	12,586.00	0.01
309	002352	顺丰控股	400	12,504.00	0.01
310	002078	太阳纸业	1,000	12,490.00	0.01
311	000425	徐工机械	1,500	12,135.00	0.01
312	600875	东方电气	400	11,508.00	0.01
313	300568	星源材质	600	11,232.00	0.01
314	300457	赢合科技	500	10,540.00	0.01
315	603806	福斯特	600	10,074.00	0.01
316	600674	川投能源	700	9,919.00	0.01
317	603260	合盛硅业	200	9,652.00	0.01
318	300342	天银机电	200	9,400.00	0.01
319	300122	智飞生物	800	9,352.00	0.01
320	603833	欧派家居	300	9,033.00	0.01
321	300118	东方日升	700	8,715.00	0.01
322	601800	中国交建	1,500	8,565.00	0.01
323	688599	天合光能	600	8,472.00	0.01
324	600316	洪都航空	300	8,382.00	0.01
324	300115	长盈精密	300	8,382.00	0.01
325	603899	晨光股份	400	8,252.00	0.01
326	600704	物产中大	1,700	8,024.00	0.01
327	600258	首旅酒店	700	7,644.00	0.01
328	002064	华峰化学	800	7,592.00	0.01
329	000063	中兴通讯	200	7,238.00	0.00
330	300070	碧水源	2,200	7,018.00	0.00
331	000932	华菱钢铁	1,900	6,593.00	0.00
332	002572	索菲亚	900	6,570.00	0.00
333	600325	华发股份	2,600	6,006.00	0.00
334	002756	永兴材料	100	5,664.00	0.00
335	002891	中宠股份	200	5,344.00	0.00

336	002050	三花智控	100	4,383.00	0.00
337	000960	锡业股份	100	4,269.00	0.00
338	300418	昆仑万维	100	4,036.00	0.00
339	300677	英科医疗	100	3,917.00	0.00
340	601669	中国电建	800	3,760.00	0.00
341	600438	通威股份	300	3,633.00	0.00
342	600010	包钢股份	1,500	3,345.00	0.00
343	002001	新 和 成	100	2,842.00	0.00
344	002131	利欧股份	500	2,375.00	0.00
345	600406	国电南瑞	100	2,285.00	0.00
346	601985	中国核电	200	1,806.00	0.00
347	002601	龙佰集团	100	1,648.00	0.00
348	002459	晶澳科技	200	1,620.00	0.00
349	600497	驰宏锌锗	100	1,211.00	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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300434	金石亚药	26,800	300,964.00	0.20
2	002379	宏桥控股	17,300	255,521.00	0.17
3	603444	吉比特	700	250,894.00	0.17
4	601061	中信金属	21,900	235,863.00	0.16
5	300613	富瀚微	2,600	208,208.00	0.14
6	301051	信濠光电	10,600	205,640.00	0.14
7	688059	华锐精密	1,000	199,710.00	0.14
8	002111	威海广泰	21,800	196,200.00	0.13
9	300789	唐源电气	11,000	195,470.00	0.13
10	688127	蓝特光学	2,000	195,200.00	0.13
11	605138	盛泰集团	34,900	192,648.00	0.13

12	688633	星球石墨	6,400	190,272.00	0.13
13	600262	北方股份	9,600	189,984.00	0.13
14	300590	移为通信	13,200	189,420.00	0.13
15	000421	南京公用	38,100	188,976.00	0.13
16	603600	永艺股份	21,200	188,044.00	0.13
17	603508	思维列控	8,800	187,968.00	0.13
18	301329	信音电子	7,700	187,033.00	0.13
19	300681	英搏尔	6,500	186,030.00	0.13
20	002786	银宝山新	23,600	185,496.00	0.13
21	300511	雪榕生物	36,500	183,595.00	0.12
22	688257	新锐股份	1,800	183,420.00	0.12
23	603390	通达电气	17,500	182,700.00	0.12
24	300765	石药创新	6,700	182,441.00	0.12
25	688582	芯动联科	2,800	182,000.00	0.12
25	688538	和辉光电	70,000	182,000.00	0.12
26	603380	易德龙	4,000	180,360.00	0.12
27	000906	浙商中拓	35,700	179,928.00	0.12
28	603719	良品铺子	20,800	179,920.00	0.12
29	300406	九强生物	16,400	179,252.00	0.12
30	603013	亚普股份	11,300	178,427.00	0.12
31	603711	香飘飘	15,900	176,649.00	0.12
32	600506	统一股份	12,700	176,403.00	0.12
33	003019	宸展光电	5,400	175,770.00	0.12
34	603317	天味食品	13,500	175,635.00	0.12
35	300426	华智数媒	34,600	175,076.00	0.12
36	603967	中创物流	16,800	173,880.00	0.12
37	002841	视源股份	5,000	172,650.00	0.12
38	301299	卓创资讯	3,900	171,834.00	0.12
39	000703	恒逸石化	12,600	170,982.00	0.12
40	603025	大豪科技	12,500	170,500.00	0.12
41	002752	昇兴股份	30,800	170,016.00	0.12

42	002142	宁波银行	5,700	169,233.00	0.11
43	001221	悍高集团	4,200	168,924.00	0.11
44	301356	天振股份	6,400	168,128.00	0.11
45	301195	北路智控	6,100	165,310.00	0.11
46	301116	益客食品	19,300	165,208.00	0.11
47	002796	世嘉科技	4,000	163,120.00	0.11
48	688299	长阳科技	9,600	160,416.00	0.11
49	301068	大地海洋	6,700	159,460.00	0.11
50	002265	建设工业	9,100	158,340.00	0.11
51	300822	贝仕达克	13,500	157,950.00	0.11
52	603897	长城科技	4,800	155,808.00	0.11
53	300772	运达股份	12,600	154,980.00	0.11
54	300882	万胜智能	9,300	154,194.00	0.10
55	605055	迎丰股份	15,000	153,000.00	0.10
56	300504	天邑股份	9,200	148,396.00	0.10
57	000589	贵州轮胎	36,000	146,160.00	0.10
58	301038	深水规院	9,000	145,440.00	0.10
59	603629	利通电子	800	143,048.00	0.10
60	002403	爱仕达	15,900	141,828.00	0.10
61	300870	欧陆通	400	138,276.00	0.09
62	300968	格林精密	14,300	137,852.00	0.09
63	688620	安凯微	8,000	129,600.00	0.09
64	301277	新天地	14,700	128,625.00	0.09
65	300891	惠云钛业	19,900	125,967.00	0.09
66	301328	维峰电子	1,730	123,176.00	0.08
67	002955	鸿合科技	3,400	121,550.00	0.08
68	688046	药康生物	5,000	121,000.00	0.08
69	603680	今创集团	12,200	119,682.00	0.08
70	688061	灿瑞科技	2,400	119,208.00	0.08
71	001217	华尔泰	13,900	117,177.00	0.08
72	301536	星宸科技	900	115,839.00	0.08

73	002803	吉宏股份	4,400	113,696.00	0.08
74	601966	玲珑轮胎	11,100	113,109.00	0.08
75	301666	大普微	236	109,345.88	0.07
76	300508	维宏股份	1,900	109,117.00	0.07
77	600469	风神股份	19,800	107,712.00	0.07
78	688249	晶合集成	1,800	106,254.00	0.07
79	301280	珠城科技	2,100	106,197.00	0.07
80	688768	容知日新	2,000	103,080.00	0.07
81	001360	南矿集团	5,800	102,602.00	0.07
82	603727	博迈科	6,000	102,360.00	0.07
83	300314	戴维医疗	10,900	101,479.00	0.07
84	000968	蓝焰控股	16,700	100,033.00	0.07
85	002905	金逸影视	14,800	99,900.00	0.07
86	600793	宜宾纸业	8,300	99,849.00	0.07
87	301011	华立科技	6,900	97,566.00	0.07
88	601688	华泰证券	4,700	96,914.00	0.07
89	688513	苑东生物	2,200	96,712.00	0.07
90	002152	广电运通	10,200	95,676.00	0.06
91	301052	果麦文化	4,300	95,546.00	0.06
92	301448	开创电气	2,100	95,298.00	0.06
93	603706	东方环宇	5,500	95,095.00	0.06
94	601595	上海电影	5,700	94,620.00	0.06
95	688683	莱尔科技	2,484	94,193.28	0.06
96	688719	爱科赛博	1,200	92,400.00	0.06
97	002409	雅克科技	400	89,800.00	0.06
98	600657	信达地产	38,500	88,935.00	0.06
99	300248	新开普	11,500	88,665.00	0.06
100	600999	招商证券	4,100	86,510.00	0.06
101	605319	无锡振华	3,800	86,222.00	0.06
102	000983	山西焦煤	14,800	85,840.00	0.06
103	301009	可靠股份	10,500	85,785.00	0.06

104	603896	寿仙谷	6,600	85,470.00	0.06
105	600027	华电国际	18,500	82,325.00	0.06
106	688070	纵横股份	2,200	82,126.00	0.06
107	600961	株冶集团	2,500	80,975.00	0.05
108	000735	罗牛山	16,800	79,800.00	0.05
109	688687	凯因科技	4,800	78,288.00	0.05
110	000783	长江证券	7,900	77,025.00	0.05
111	603396	金辰股份	2,900	76,850.00	0.05
112	300740	水羊股份	4,100	75,481.00	0.05
113	688606	奥泰生物	1,825	74,971.00	0.05
114	688313	仕佳光子	400	73,860.00	0.05
115	600517	国网英大	15,600	73,008.00	0.05
116	300921	南凌科技	3,500	71,085.00	0.05
117	002772	众兴菌业	6,200	70,432.00	0.05
118	002923	润都股份	7,400	70,004.00	0.05
119	605158	华达新材	10,900	69,760.00	0.05
120	601898	中煤能源	5,700	69,426.00	0.05
121	300580	贝斯特	3,300	66,363.00	0.05
122	601995	中金公司	1,800	65,070.00	0.04
123	601009	南京银行	6,500	64,285.00	0.04
124	002245	蔚蓝锂芯	3,344	62,566.24	0.04
125	001248	华润新能源	6,167	62,348.37	0.04
126	300916	朗特智能	2,600	60,762.00	0.04
127	688808	联讯仪器	38	60,204.54	0.04
128	603195	公牛集团	1,500	58,725.00	0.04
129	002624	完美世界	4,700	58,374.00	0.04
130	601665	齐鲁银行	10,100	58,277.00	0.04
131	600685	中船防务	2,200	55,968.00	0.04
132	601997	贵阳银行	10,900	55,917.00	0.04
133	300957	贝泰妮	1,700	53,567.00	0.04
134	600828	茂业商业	14,700	52,626.00	0.04

135	300824	北鼎股份	7,200	51,696.00	0.04
136	600801	华新建材	3,300	51,480.00	0.03
137	300577	开润股份	3,400	49,674.00	0.03
138	688692	达梦数据	200	48,858.00	0.03
139	000951	中国重汽	2,500	48,775.00	0.03
140	002416	爱施德	5,400	48,384.00	0.03
141	603345	安井食品	600	48,114.00	0.03
142	002568	百润股份	2,700	45,684.00	0.03
143	300413	芒果超媒	3,100	45,353.00	0.03
144	002054	德美化工	6,800	45,220.00	0.03
145	300154	瑞凌股份	5,800	43,616.00	0.03
146	301380	挖金客	1,400	38,626.00	0.03
147	002850	科达利	200	37,860.00	0.03
147	000708	中信特钢	3,000	37,860.00	0.03
148	300628	亿联网络	1,100	37,202.00	0.03
149	601138	工业富联	500	36,075.00	0.02
150	603301	振德医疗	400	34,864.00	0.02
151	688818	电科蓝天	488	34,228.32	0.02
152	688820	盛合晶微	239	33,816.11	0.02
153	300956	英力股份	3,000	33,720.00	0.02
154	600919	江苏银行	2,900	31,262.00	0.02
155	603588	高能环境	1,600	30,720.00	0.02
156	600764	中国海防	1,700	29,631.00	0.02
157	601998	中信银行	4,200	29,106.00	0.02
158	688428	诺诚健华	1,000	28,470.00	0.02
159	688150	莱特光电	400	27,448.00	0.02
160	301003	江苏博云	500	26,750.00	0.02
161	300627	华测导航	900	25,560.00	0.02
162	300787	海能实业	2,700	24,624.00	0.02
163	300199	翰宇药业	1,100	24,288.00	0.02
164	601939	建设银行	2,400	23,112.00	0.02

165	301682	宏明电子	141	22,568.46	0.02
166	600261	阳光照明	7,200	22,176.00	0.02
167	300365	恒华科技	4,800	21,984.00	0.01
168	002859	洁美科技	200	21,902.00	0.01
169	301322	绿通科技	400	21,340.00	0.01
170	002933	新兴装备	800	20,680.00	0.01
171	688635	长进光子	67	20,648.73	0.01
172	300980	祥源新材	700	20,587.00	0.01
173	002343	慈文传媒	4,700	20,492.00	0.01
174	688785	恒运昌	44	20,378.60	0.01
175	002441	众业达	2,600	20,280.00	0.01
176	001365	天海电子	544	20,068.84	0.01
177	688813	泰金新能	115	19,790.35	0.01
178	603920	世运电路	400	19,216.00	0.01
179	603998	方盛制药	2,100	18,963.00	0.01
180	601126	四方股份	300	18,960.00	0.01
181	001238	浙江正特	700	18,942.00	0.01
182	002154	报喜鸟	5,300	18,868.00	0.01
183	000020	深华发A	1,700	18,530.00	0.01
184	002835	同为股份	1,600	18,352.00	0.01
185	688489	三未信安	792	17,978.40	0.01
186	603987	康德莱	2,600	17,940.00	0.01
187	600871	石化油服	8,800	17,864.00	0.01
188	001318	阳光乳业	1,800	17,838.00	0.01
189	002792	通宇通讯	500	17,785.00	0.01
190	002930	宏川智慧	1,900	17,480.00	0.01
191	601808	中海油服	1,600	17,296.00	0.01
192	601777	千里科技	2,100	17,136.00	0.01
193	603999	读者传媒	3,300	16,500.00	0.01
194	301082	久盛电气	1,700	15,232.00	0.01
195	002096	易普力	1,700	14,926.00	0.01

196	300022	吉峰科技	1,900	14,763.00	0.01
197	300533	冰川网络	900	14,760.00	0.01
198	688611	杭州柯林	200	14,290.00	0.01
199	688191	智洋创新	400	14,280.00	0.01
200	603677	奇精机械	1,100	14,135.00	0.01
201	688781	视涯科技	293	13,949.73	0.01
202	301168	通灵股份	300	13,473.00	0.01
203	600560	金自天正	1,200	13,296.00	0.01
204	001257	盛龙股份	627	13,003.98	0.01
205	688658	悦康药业	1,000	12,860.00	0.01
206	300856	科思股份	1,200	12,792.00	0.01
207	600648	外高桥	1,600	12,784.00	0.01
208	603511	爱慕股份	1,100	12,650.00	0.01
209	301004	嘉益股份	400	12,400.00	0.01
210	603969	银龙股份	1,700	12,359.00	0.01
211	603868	飞科电器	400	12,320.00	0.01
212	002145	钛能化学	2,500	11,775.00	0.01
213	000411	英特集团	1,300	11,739.00	0.01
214	600386	北巴传媒	3,700	11,544.00	0.01
215	603767	中马传动	800	11,376.00	0.01
216	601881	中国银河	900	11,313.00	0.01
217	301552	科力装备	500	11,165.00	0.01
218	688685	迈信林	200	10,980.00	0.01
219	603391	力聚热能	200	10,876.00	0.01
220	605077	华康股份	1,000	10,810.00	0.01
221	300596	利安隆	200	10,496.00	0.01
222	605089	味知香	500	10,495.00	0.01
223	003001	中岩大地	800	10,360.00	0.01
224	300231	银信科技	1,300	10,335.00	0.01
225	688566	吉贝尔	400	10,236.00	0.01
226	000404	长虹华意	1,300	10,218.00	0.01

227	301538	骏鼎达	200	10,074.00	0.01
228	300695	兆丰股份	200	9,958.00	0.01
229	603586	金麒麟	800	9,912.00	0.01
230	603262	技源集团	400	9,848.00	0.01
231	300349	金卡智能	900	9,846.00	0.01
232	300404	博济医药	1,100	9,636.00	0.01
233	600292	电投水电	800	9,632.00	0.01
234	000848	承德露露	1,300	9,620.00	0.01
235	001288	运机集团	400	9,516.00	0.01
236	688377	迪威尔	400	9,432.00	0.01
237	300586	美联新材	600	9,384.00	0.01
238	301633	港迪技术	200	9,362.00	0.01
239	301531	春光集团	180	9,280.80	0.01
240	301035	润丰股份	200	9,280.00	0.01
241	301181	标榜股份	400	9,256.00	0.01
242	603187	海容冷链	800	9,192.00	0.01
243	688577	浙海德曼	200	9,166.00	0.01
244	300515	三德科技	700	9,135.00	0.01
245	688579	地纬智能	1,200	9,108.00	0.01
246	603689	皖天然气	1,300	9,009.00	0.01
247	300844	山水比德	400	8,884.00	0.01
248	002103	广博股份	1,500	8,805.00	0.01
249	300184	力源信息	500	8,775.00	0.01
250	603579	荣泰健康	500	8,485.00	0.01
251	603020	爱普股份	600	8,460.00	0.01
252	301636	泽润新能	200	8,422.00	0.01
253	301696	三瑞智能	97	8,419.60	0.01
254	002398	垒知集团	2,200	8,250.00	0.01
255	603657	春光科技	300	8,169.00	0.01
256	688805	健信超导	173	8,125.81	0.01
257	002716	湖南白银	1,000	8,090.00	0.01

258	301026	浩通科技	400	8,088.00	0.01
259	300752	隆利科技	600	8,082.00	0.01
260	601065	江盐集团	1,200	8,052.00	0.01
261	301560	众捷汽车	300	8,019.00	0.01
262	300384	三联虹普	700	7,980.00	0.01
263	301316	慧博云通	200	7,876.00	0.01
264	301500	飞南资源	300	7,815.00	0.01
265	301270	汉仪股份	300	7,704.00	0.01
266	603407	长裕集团	104	7,639.84	0.01
267	000655	金岭矿业	1,200	7,632.00	0.01
268	300922	天秦装备	500	7,575.00	0.01
269	300753	爱朋医疗	400	7,572.00	0.01
270	300982	苏文电能	500	7,555.00	0.01
271	603070	万控智造	600	7,548.00	0.01
272	301180	万祥科技	600	7,518.00	0.01
273	002644	佛慈制药	1,100	7,491.00	0.01
274	603296	华勤技术	100	7,427.00	0.01
275	688648	中邮科技	200	7,310.00	0.00
276	300164	通源石油	900	7,200.00	0.00
277	301383	天键股份	300	7,170.00	0.00
278	605339	南侨食品	600	7,164.00	0.00
279	601838	成都银行	400	7,080.00	0.00
280	301102	兆讯传媒	800	6,840.00	0.00
281	605068	明新旭腾	400	6,712.00	0.00
282	301050	雷电微力	200	6,688.00	0.00
283	603235	天新药业	300	6,675.00	0.00
284	301202	朗威股份	200	6,666.00	0.00
285	605218	伟时电子	400	6,612.00	0.00
286	600796	钱江生化	1,400	6,496.00	0.00
287	300774	倍杰特	600	6,450.00	0.00
288	600037	歌华有线	1,000	6,270.00	0.00

289	300817	双飞集团	400	6,240.00	0.00
290	301599	理奇智能	191	6,201.77	0.00
291	600301	华锡有色	100	6,132.00	0.00
292	600251	冠农股份	700	6,048.00	0.00
292	301112	信邦智能	200	6,048.00	0.00
293	301479	弘景光电	100	6,020.00	0.00
293	002355	兴民智通	1,400	6,020.00	0.00
294	301680	固德电材	52	5,832.32	0.00
295	300563	神宇股份	200	5,678.00	0.00
296	301016	雷尔伟	400	5,588.00	0.00
297	300229	拓尔思	400	5,528.00	0.00
298	000701	厦门信达	1,200	5,316.00	0.00
299	603355	莱克电气	200	5,276.00	0.00
300	300781	因赛集团	200	5,272.00	0.00
301	301132	满坤科技	100	5,252.00	0.00
302	003022	联泓新科	200	5,180.00	0.00
303	301033	迈普医学	100	5,179.00	0.00
304	301513	尚水智能	101	5,146.96	0.00
305	600446	金证股份	500	5,030.00	0.00
306	301100	风光股份	346	4,809.40	0.00
307	688252	天德钰	200	4,800.00	0.00
308	301028	鼎熔岩	300	4,788.00	0.00
309	002395	双象股份	400	4,784.00	0.00
310	688510	航亚科技	200	4,776.00	0.00
311	002045	国光电器	600	4,710.00	0.00
312	002079	苏州固锝	300	4,509.00	0.00
313	001393	维通利	114	4,444.86	0.00
314	301187	欧圣电气	300	4,293.00	0.00
315	603661	恒林股份	100	4,000.00	0.00
316	002666	德联集团	1,000	3,950.00	0.00
317	688816	易思维	69	3,939.90	0.00

318	688712	北芯生命	108	3,879.36	0.00
319	001237	惠康科技	65	3,818.10	0.00
320	688292	浩瀚深度	200	3,720.00	0.00
320	000812	陕西金叶	1,200	3,720.00	0.00
321	300942	易瑞生物	600	3,468.00	0.00
322	600351	亚宝药业	600	3,450.00	0.00
323	301397	溯联股份	100	3,236.00	0.00
324	600023	浙能电力	600	3,156.00	0.00
325	603409	汇通控股	170	3,119.50	0.00
326	300388	节能国祯	500	3,085.00	0.00
327	300174	元力股份	100	2,922.00	0.00
328	600926	杭州银行	200	2,890.00	0.00
329	688410	山外山	200	2,872.00	0.00
330	301062	上海艾录	500	2,855.00	0.00
331	000498	山东路桥	600	2,838.00	0.00
332	601112	振石股份	159	2,796.81	0.00
333	301311	昆船智能	200	2,598.00	0.00
334	600797	浙大网新	400	2,560.00	0.00
335	600467	好当家	1,200	2,364.00	0.00
336	601818	光大银行	800	2,312.00	0.00
337	600566	济川药业	100	2,219.00	0.00
338	300840	酷特智能	100	2,063.00	0.00
339	603418	友升股份	46	2,031.82	0.00
340	603406	天富龙	69	1,790.55	0.00
341	601229	上海银行	200	1,736.00	0.00
342	300363	博腾股份	100	1,624.00	0.00
343	300451	创业慧康	500	1,600.00	0.00
344	600558	大西洋	300	1,482.00	0.00
345	601699	潞安环能	100	1,428.00	0.00
346	603352	至信股份	52	1,327.04	0.00
347	001220	世盟股份	44	1,222.32	0.00

348	001322	箭牌家居	200	1,208.00	0.00
349	002986	宇新股份	100	1,183.00	0.00
350	600098	广州发展	200	1,182.00	0.00
351	603284	林平发展	33	1,150.71	0.00
352	001312	福恩股份	57	956.46	0.00
353	603293	埃泰克	28	950.04	0.00
354	000060	中金岭南	100	757.00	0.00
355	000825	太钢不锈	200	682.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688012	中微公司	2,146,126.04	1.20
2	300308	中际旭创	2,112,705.00	1.18
3	601398	工商银行	1,981,723.00	1.11
4	601899	紫金矿业	1,893,743.00	1.06
5	002475	立讯精密	1,868,467.00	1.04
6	300502	新易盛	1,806,365.00	1.01
7	300394	天孚通信	1,621,810.00	0.91
8	603986	兆易创新	1,570,885.00	0.88
9	600150	中国船舶	1,432,144.00	0.80
10	600104	上汽集团	1,430,993.00	0.80
11	000426	兴业银锡	1,424,570.00	0.80
12	601600	中国铝业	1,382,151.00	0.77
13	002463	沪电股份	1,360,198.00	0.76
14	603993	洛阳钼业	1,332,236.00	0.74
15	300476	胜宏科技	1,285,627.00	0.72
16	688256	寒武纪	1,265,314.00	0.71

17	002493	荣盛石化	1,255,276.00	0.70
18	601816	京沪高铁	1,236,578.00	0.69
19	000725	京东方 A	1,228,935.00	0.69
20	000338	潍柴动力	1,218,072.00	0.68

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	2,590,749.00	1.45
2	600519	贵州茅台	2,330,298.00	1.30
3	601318	中国平安	2,248,502.00	1.26
4	601398	工商银行	2,112,238.00	1.18
5	300502	新易盛	2,080,177.92	1.16
6	601899	紫金矿业	1,924,514.00	1.08
7	300308	中际旭创	1,822,391.00	1.02
8	000338	潍柴动力	1,804,192.00	1.01
9	002475	立讯精密	1,759,986.00	0.98
10	600036	招商银行	1,755,881.00	0.98
11	601600	中国铝业	1,633,229.00	0.91
12	300394	天孚通信	1,626,551.00	0.91
13	601166	兴业银行	1,581,262.00	0.88
14	600887	伊利股份	1,560,545.00	0.87
15	000333	美的集团	1,512,043.00	0.84
16	002001	新 和 成	1,410,081.00	0.79
17	002463	沪电股份	1,393,497.00	0.78
18	601816	京沪高铁	1,380,481.00	0.77
19	000725	京东方 A	1,376,585.00	0.77
20	601872	招商轮船	1,360,763.80	0.76

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	304,236,755.77
卖出股票收入（成交）总额	340,114,639.28

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)	3,146.04	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,146.04	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	118068	迪威转债	20	3,146.04	0.00

注:本基金本报告期末仅持有一只债券。

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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期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 基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

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	346,625.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	346,625.64

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	852	57,550.12	15,736,072.56	32.0 9%	33,296,627.07	67.91%
泓德 中证A 500指 数增 强C	1,0 65	50,054.47	4,473,558.38	8.39%	48,834,450.77	91.61%
合计	1,8	54,148.52	20,209,630.94	19.7	82,131,077.84	80.25%

	90			5%		
--	----	--	--	----	--	--

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
本报告期期初基金份额总额	52,856,626.21	88,646,471.16
本报告期基金总申购份额	18,347,470.82	44,369,092.16
减：本报告期基金总赎回份额	22,171,397.40	79,707,554.17
本报告期基金拆分变动份额	-	-

本报告期期末基金份额总额	49,032,699.63	53,308,009.15
--------------	---------------	---------------

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

§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

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

（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，本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

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公募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

本报告期未发生公司被中国证监会、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 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，未发生管理人高级管理人员及其他从业人员受调查或处罚的情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

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

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门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	
金融街证券	3	372,875,908.37	57.93%	69,317.88	57.93%	-
国联民生证券	2	270,786,168.20	42.07%	50,341.80	42.07%	-

- 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、金融街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	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
金融街证券	55,115.23	67.87%	-	-	-	-	-	-
国联民生证券	26,085.91	32.13%	-	-	-	-	-	-

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增加民生证券股份有限公司为销售机构并参与其费率优惠的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2026-02-07
2	泓德基金管理有限公司关于旗下基金参与北京汇成基金销售有限公司费率优惠活动的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-10
3	泓德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）	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
4	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加粤开证券股份有限公司为销售机构并参与其费率优惠的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-10
5	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东莞证券股份有限公司为销售机构并参与其费率优惠的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2026-05-22
6	泓德基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司代销本公司旗下基金的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2026-05-29

§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
二〇二六年八月二十九日