

海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金

2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：二〇二五年八月三十日

§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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 29 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 25 日（基金合同生效日）起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
§ 2 基金简介	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	16
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18
6.3 净资产变动表	19
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	55
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	55
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	55
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	56
§ 8 基金份额持有人信息	56

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	57
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	57
§ 9 开放式基金份额变动	58
§ 10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	59
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
10.8 其他重大事件	60
11 影响投资者决策的其他重要信息	61
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	61
§ 12 备查文件目录	62
12.1 备查文件目录	62
12.2 存放地点	62
12.3 查阅方式	62

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	海富通中证 A500 指数增强	
基金主代码	023367	
基金运作方式	契约型开放式、发起式	
基金合同生效日	2025 年 3 月 25 日	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	113,285,852.23 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通中证 A500 指数增强 A	海富通中证 A500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	023367	023368
报告期末下属分级基金的份额总额	92,184,933.84 份	21,100,918.39 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，在对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的投资策略模型进行积极的指数组合管理与风险控制，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。
投资策略	1、股票投资策略 （1）标的指数：本基金股票资产跟踪的标的指数为中证 A500 指数。 （2）量化增强策略 本基金一方面采用指数化被动投资策略以追求有效跟踪标的指数，避免大幅偏离标的指数；另一方面采用量化模型调整投资组合，力求实现高于标的指数的投资收益。本基金运用的量化投资模型借鉴国际一流定量分析的应用经验，利用多因子 alpha 模型预测股票超额回报，在有效风险控制及交易成本最低化的基础上优化投资组合。主要包括：多因子 alpha 模型——股票超额回报预测、风险估测模型——有效控制风险预算、交易成本模型——控制成本并保护业绩和投资组合优化模型。 2、债券投资策略；3、可转换债券和可交换债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、股指期货投资策略；6、国债期货投资策略；7、股票期权投资策略；8、融资及转融通证券出借策略；9、存托凭证投资策略。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。同时，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		海富通基金管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	岳冲	朱萍
	联系电话	021-38650788	021-31888888
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	Zhup02@spdb.com.cn
客户服务电话		40088-40099	95528
传真		021-33830166	021-63602540
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路479号18层 1802-1803室以及19层 1901-1908室	上海市中山东一路12号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路479号18层 1802-1803室以及19层 1901-1908室	上海市博成路1388号浦银中心 A栋
邮政编码		200120	200126
法定代表人		谢乐斌	张为忠

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.hftfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	海富通基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 18 层 1802-1803 室以及 19 层 1901-1908 室

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 3 月 25 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日)	
	海富通中证 A500 指数增强 A	海富通中证 A500 指数增强 C
本期已实现收益	3,395,685.88	1,066,146.69
本期利润	4,542,635.76	1,720,680.12
加权平均基金份额本期利润	0.0373	0.0313
本期加权平均净值利润率	3.70%	3.11%
本期基金份额净值增长率	3.78%	3.67%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
	海富通中证 A500 指数增强 A	海富通中证 A500 指数增强 C
期末可供分配利润	2,999,838.13	662,684.26
期末可供分配基金份额利润	0.0325	0.0314
期末基金资产净值	95,673,038.59	21,875,255.66
期末基金份额净值	1.0378	1.0367
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
	海富通中证 A500 指数增强 A	海富通中证 A500 指数增强 C
基金份额累计净值增长率	3.78%	3.67%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

4、本基金合同生效日为 2025 年 3 月 25 日，合同生效当年期间的数据和指标按实际存续期计算。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

海富通中证 A500 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	2.81%	0.58%	2.68%	0.57%	0.13%	0.01%
过去三个月	3.83%	0.52%	0.83%	1.14%	3.00%	-0.62%
自基金合同生	3.78%	0.50%	-0.61%	1.10%	4.39%	-0.60%

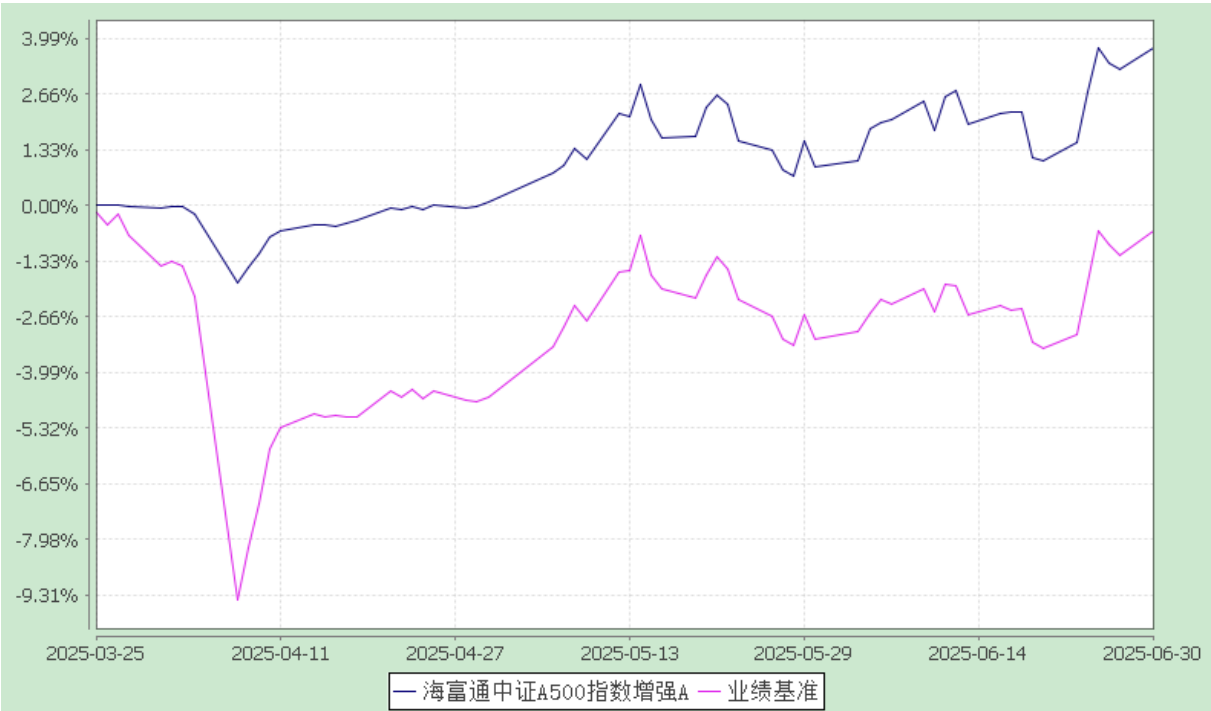
效起至今						
海富通中证 A500 指数增强 C						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	2.79%	0.58%	2.68%	0.57%	0.11%	0.01%
过去三个月	3.73%	0.52%	0.83%	1.14%	2.90%	-0.62%
自基金合同生效起至今	3.67%	0.50%	-0.61%	1.10%	4.28%	-0.60%

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

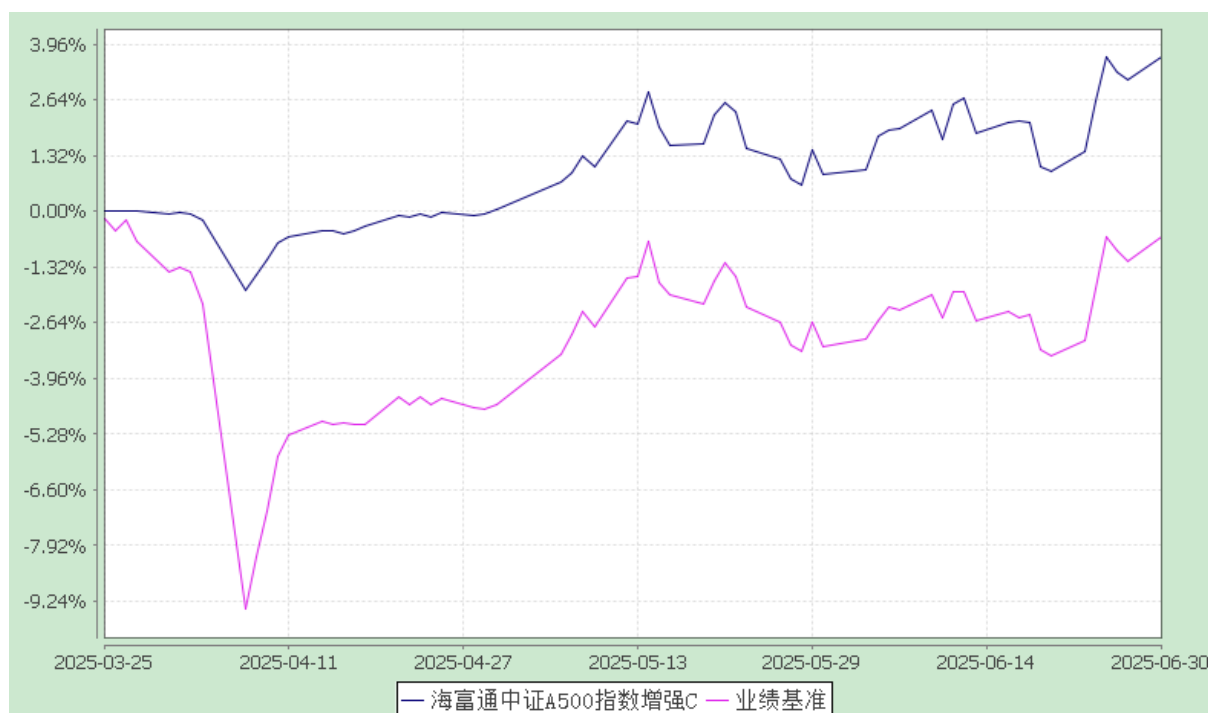
海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2025 年 3 月 25 日至 2025 年 6 月 30 日)

海富通中证 A500 指数增强 A



海富通中证 A500 指数增强 C



注：1、本基金合同于 2025 年 3 月 25 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。截止本报告期末，本基金尚处于建仓期。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2025 年 6 月 30 日，本基金管理人旗下运作的公募基金共有 98 只，分别是：海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通股票混合型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通风格优势混合型证券投资基金、海富通精选贰号混合型证券投资基金、海富通中国海外精选混合型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通领先成长混合型证券投资基金、海富通中证 A100 指数证券投资基金（LOF）、海富通中小盘混合型证券投资基金、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通国策导向混合型证券投资基金、海富通中证 500 指数增强型证券投资基金、海富通安颐收益混合型证券投资基金、海富通一年定期开放债券型证券投资基金、海富通内需热点混合型证券投资基金、海富通纯债债券型证券投资基金、上证城投债交易型开放式指数证券投资基金、海富通阿尔法对冲混合型发起式证

券投资基金、海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金、海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞丰债券型证券投资基金、海富通聚利纯债债券型证券投资基金、海富通集利纯债债券型证券投资基金、海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）、海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞利纯债债券型证券投资基金、海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞合纯债债券型证券投资基金、海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金、海富通瑞福债券型证券投资基金、海富通瑞祥一年定期开放债券型证券投资基金、海富通添益货币市场基金、海富通聚优精选混合型基金中基金（FOF）、海富通量化先锋股票型证券投资基金、海富通融丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金、海富通恒丰定期开放债券型发起式证券投资基金、上证 10 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通弘丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通鼎丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通电子信息传媒产业股票型证券投资基金、海富通上海清算所中高等级短期融资券指数证券投资基金、海富通研究精选混合型证券投资基金、海富通稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通中短债债券型证券投资基金、海富通聚合纯债债券型证券投资基金、海富通上证 5 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通先进制造股票型证券投资基金、海富通裕通 30 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金、海富通平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通科技创新混合型证券投资基金、海富通裕昇三年定期开放债券型证券投资基金、海富通瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通富盈混合型证券投资基金、海富通富泽混合型证券投资基金、海富通上证投资级可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金、海富通成长甄选混合型证券投资基金、海富通消费核心资产混合型证券投资基金、海富通成长价值混合型证券投资基金、海富通均衡甄选混合型证券投资基金、海富通欣睿混合型证券投资基金、海富通消费优选混合型证券投资基金、海富通中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、海富通策略收益债券型证券投资基金、海富通中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、海富通利率债债券型证券投资基金、海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金、海富通瑞兴 3 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通欣利混合型证券投资基金、海富通碳中和主题混合型证券投资基金、海富通成长领航混合型证券投资基金、海富通养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通恒益金融债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通盈丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通添利收益一年持有期债券型证券投资基金、海富通悦享一年持有期混合型证券投资基金、海富通产业优选混合型证券投资基金、海富通瑞鑫 30 天持有期债券型

证券投资基金、海富通优势驱动混合型证券投资基金、海富通中债 0-2 年政策性金融债指数证券投资基金、海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、海富通红利优选混合型证券投资基金、海富通中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、海富通量化选股混合型证券投资基金、海富通上证基准做市公司债交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金、海富通远见回报混合型证券投资基金、海富通配置优选三个月持有期混合型基金中基金(FOF)、海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金、海富通中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、海富通致远量化选股股票型发起式证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
朱斌全	本基金的基金经理	2025-03-25	-	18 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。2005 年 7 月至 2006 年 8 月任上海涅柔斯投资管理有限公司美股交易员。2007 年 4 月加入海富通基金管理有限公司，历任交易员、高级交易员、量化分析师、投资经理、基金经理助理。2018 年 11 月至 2022 年 8 月任海富通阿尔法对冲混合基金经理。2019 年 10 月至 2022 年 12 月兼任海富通富祥混合基金经理。2019 年 10 月起兼任海富通沪深 300 增强(原海富通富睿混合)、海富通欣益混合的基金经理。2019 年 10 月至 2025 年 5 月兼任海富通量化多因子混合基金经理。2020 年 10 月起兼任海富通欣享混合的基金经理。2020 年 10 月至 2022 年 8 月兼任海富通新内需混合基金经理。2022 年 8 月起兼任海富通安益对冲混合基金经理。2022 年 12 月至 2024 年 4 月兼任海富通量化先锋股票、海富通中证 500 增强基金经理。2024 年 3 月至 2025 年 6 月兼任海富通中证 2000 增强策略 ETF 基金经理。2025 年 3 月起兼任海富通中证 A500 指数增强基金经理。
林立禾	本基金的基金经理	2025-03-25	-	6 年	美国密歇根大学定量金融与风险管理硕士，持有基金从业人员资格

					证书。历任中欧基金管理有限公司风险管理部量化风控岗。2020 年 8 月加入海富通基金管理有限公司，历任量化研究员、量化投资部基金经理助理。2023 年 11 月起任海富通富利三个月持有、海富通沪深 300 增强的基金经理。2023 年 11 月至 2025 年 3 月兼任海富通欣益混合的基金经理。2024 年 10 月至 2025 年 5 月兼任海富通量化多因子混合基金经理。2025 年 1 月起兼任海富通中证 500 指数增强基金经理。2025 年 3 月起兼任海富通量化先锋股票、海富通中证 A500 指数增强基金经理。2025 年 6 月起兼任海富通致远量化选股股票发起基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

2、证券从业年限的计算标准：自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金资产，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

报告期内，公司对旗下所有投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行了分析，并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（如 1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合向交易的样本，对其进行了 95%置信区间，假设溢价率为 0 的 T 分布检验，结合该时间窗下组

合互相之间的模拟输送金额、贡献度、交易占优比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明，报告期内公司对旗下各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

国内方面，上半年经济运行稳中向好，实现了实际 GDP 增速 5.3%。节奏上，今年一季度经济实现开门红，实际 GDP 同比增长 5.4%，二季度在关税战扰动下，经济增长仍有韧性，实际 GDP 同比增长 5.2%。结构上，在抢出口影响下上半年国内生产和出口保持强势，在消费补贴支撑下上半年社零稳健增长，但国内地产仍在寻底，固定资产投资增速走低；政策上，今年 3 月两会财政目标赤字率提高至 4.0%左右，5 月央行降准降息，财政政策靠前发力，有力支撑经济增长。同时，国内坚持高质量发展，因地制宜发展新质生产力，把科技创新作为经济复苏与重塑竞争优势的战略方向。

海外方面，一季度美国抢进口导致 GDP 负增，降息预期不断延后。美国 OBBB 减税法案已经通过，财政赤字率温和扩张，对美国经济起到托底作用。6 月美国通胀数据显示关税推升商品通胀，美联储更倾向于等待关税扰动结束后再采取行动。

从 A 股市场运行来看，上半年上证指数涨幅为 2.76%，沪深 300 为 0.03%，中证 800 为 0.87%，创业板指为 0.53%。行业板块方面，根据申万一级行业分类，表现靠前的板块是有色金属、银行、国防军工、传媒、通信，而煤炭、食品饮料、房地产、石油石化、建筑装饰等板块则表现靠后。从行情节奏看，年初市场在 DeepSeek 催化下持续上涨，但 4 月初在特朗普对等关税冲击下市场迎来调整；后续，随着中央汇金等公告增持中国股票资产，积极入市呵护市场流动性，特朗普新政引发全球恐慌加速去美元化，5 月 7 日央行宣布降准降息，5 月 12 日中美宣布日内瓦联合声明，国内市场风险偏好明显回暖，市场结构性机会不断。

回顾本报告期的投资操作，本基金一方面采用指数被动投资策略以有效跟踪标的指数，另一方面以超额稳定为首要目标，行业上多数时间超配成长板块，风格上则偏向估值相对便宜、相对位置较低的标的，总体保持均衡。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通中证 A500 指数增强 A 净值增长率为 3.78%，同期业绩比较基准收益率为 -0.61%。海富通中证 A500 指数增强 C 净值增长率为 3.67%，同期业绩比较基准收益率为 -0.61%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从国内经济来看，今年上半年 GDP 增速略超预期，全年 GDP 增速实现 5% 的难度不大。海外经济方面，特朗普发动的关税战抑制全球需求，降低了全球经济增长预期。目前市场比较关注美联储的降息节奏，一旦美联储启动降息，将对全球金融市场、各类资产产生显著影响，外部金融环境有望改善。但是，由于特朗普发动的关税战持续扰动通胀，美联储降息路径有不确定性。

从资本市场看，今年两会再提了“稳住楼市股市”，7 月中共中央政治局会议强调“增强国内资本市场的吸引力和包容性，巩固资本市场回稳向好势头”，在监管层的积极呵护下，市场信心得到提振，资本市场有望实现震荡向上。从投资机会看，市场主线或更丰富，呈现多点开花的局面。

投资策略上，我们拥抱以机器学习和深度学习算法构建的 AI 策略，策略以超额稳定和投资者持有体验为首要目标。展望未来，三季度本基金计划降低部分基准指数成分股比例，在保持风格、行业的相对风险暴露依然可控的基础上，引入一些具备更强弹性的 alpha 策略，以提升超额曲线的斜率，但总体来说，本基金将延续“以稳为主”的理念，在以基准指数成份内选股为主要 alpha 来源的基础上，力求提供具有较高胜率、超额回撤幅度较低和回撤修复周期较短的指数增强产品。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

本基金本报告期内未进行利润分配，但符合基金合同规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由海富通基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	177,399.97
结算备付金		4,577,764.15
存出保证金		609,569.57
交易性金融资产	6.4.7.2	109,389,963.16
其中：股票投资		103,354,236.87
基金投资		-
债券投资		6,035,726.29
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	3,000,000.00
应收清算款		1,908,265.32
应收股利		-
应收申购款		1,342,564.79
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		121,005,526.96
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 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		3,205,140.88
应付管理人报酬		81,727.40
应付托管费		10,215.95
应付销售服务费		8,367.30
应付投资顾问费		-
应交税费		27,844.23
应付利润		-

递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	123,936.95
负债合计		3,457,232.71
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	113,285,852.23
未分配利润	6.4.7.8	4,262,442.02
净资产合计		117,548,294.25
负债和净资产总计		121,005,526.96

注：1、报告截止日 2025 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.0378 元，C 类基金份额净值 1.0367 元。基金份额总额 113,285,852.23 份，其中 A 类基金份额 92,184,933.84 份，C 类基金份额 21,100,918.39 份。

2、基金合同成立于 2025 年 03 月 25 日，上年度可比期间无比较数据。

6.2 利润表

会计主体：海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		6,809,795.49
1.利息收入		278,207.09
其中：存款利息收入	6.4.7.9	130,025.64
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		148,181.45
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,729,023.35
其中：股票投资收益	6.4.7.10	1,615,543.48
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	29,978.04
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益	6.4.7.12	-
衍生工具收益	6.4.7.13	1,653,118.54
股利收益	6.4.7.14	1,430,383.29
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	1,801,483.31
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	1,081.74
减：二、营业总支出		546,479.61
1. 管理人报酬		380,012.11
2. 托管费		47,501.53
3. 销售服务费		59,267.43
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失		-
7. 税金及附加		6,493.94
8. 其他费用	6.4.7.17	53,204.60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,263,315.88
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,263,315.88
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		6,263,315.88

注：本财务报表的实际编制期间为 2025 年 3 月 25 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日，上年度可比期间无比较数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
二、本期期初净资产	232,661,339.38	-	-	232,661,339.38
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-119,375,487.15	-	4,262,442.02	-115,113,045.13
（一）、综合收益总额	-	-	6,263,315.88	6,263,315.88
（二）、本期基金份额交易产生的	-119,375,487.15	-	-2,000,873.86	-121,376,361.01

净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）				
其中：1.基金申购款	24,655,853.07	-	551,151.43	25,207,004.50
2.基金赎回款	-144,031,340.22	-	-2,552,025.29	-146,583,365.51
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	113,285,852.23	-	4,262,442.02	117,548,294.25

注：本财务报表的实际编制期间为 2025 年 3 月 25 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日，上年度可比期间无比较数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2025]44 号《关于准予海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》注册，由海富通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型开放式证券投资基金，存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 232,598,348.48 元。经向中国证监会备案，《海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于 2025 年 3 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 232,661,339.38 份，其中认购资金利息折合基金份额 62,990.90 份。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》和《海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用及销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购基金时收取认购/申购费用，而不从本类别基金资产

中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购基金份额时不收取认购/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股、备选成份股、其他国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、科创板及其他中国证监会核准或注册上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、可交换债券及其他中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金可根据相关法律法规的规定，参与融资和转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为：本基金持有的股票资产及存托凭证占基金资产的比例为不低于 80%，其中，投资标的指数成份股及其备选成份股（含存托凭证）的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证 A500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人海富通基金管理有限公司于 2025 年 8 月 29 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2025 年 3 月 25 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日止期间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 日的财务状况以及本基金 2025 年 3 月 25 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 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资、债券投资、资产支持证券投资、衍生工具等。

本基金通常根据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，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、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摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，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。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无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。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(b) 金融负债的分类

本基金将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及以摊余成本计量的金融负债。

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债(含属于金融负债的衍生工具)和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

-以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无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。

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

(a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b) 后续计量

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

- 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

- 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；
- 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。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

(d)金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限(包括考虑续约选择权)。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内(若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期)可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，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，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，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。采用估值技术确定公允价值时，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。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似金融工具的现行市价及重大变化等因素，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

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日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。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

股票投资收益、债券投资收益、资产支持证券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生工具、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形

成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

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。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产款在资金实际占用期间按实际利率法逐日确认为利息支出。

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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

根据《海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》的规定，本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为对应类别基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金各类份额默认的收益分配方式是现金分红；本基金不同份额类别基金份额，其分红方式相互独立、互不影响；投资者不同基金交易账户设置的基金分红方式相互独立、互不影响；本基金每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告。同一类别的每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。法律法规或监管机构另有规定的或在基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

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：

对于证券交易所上市的股票和债券，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、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

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。

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》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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告 2024

年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a)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，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(b)对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。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(c)对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

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

(d)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	177,399.97
等于：本金	177,285.74
加：应计利息	114.23
定期存款	-

等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	177,399.97

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		101,530,111.40	-	103,354,236.87	1,824,125.47
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	5,956,542.16	75,726.29	6,035,726.29	3,457.84
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	5,956,542.16	75,726.29	6,035,726.29	3,457.84
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		107,486,653.56	75,726.29	109,389,963.16	1,827,583.31

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	4,690,500.00	-	-	-

——股指期货	4,690,500.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	4,690,500.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2509	IF2509	4.00	4,664,400.00	-26,100.00
合计	-	-	-	-26,100.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-26,100.00
净额	-	-	-	-

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

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	3,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	3,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末其他资产无余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	73,547.31
其中：交易所市场	73,547.31
银行间市场	-
应付利息	-

预提费用	50,389.64
合计	123,936.95

6.4.7.7 实收基金

海富通中证 A500 指数增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2025年3月25日（基金合同生效日）至2025年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	147,867,531.69	147,867,531.69
本期申购	22,245,516.53	22,245,516.53
本期赎回（以“-”号填列）	-77,928,114.38	-77,928,114.38
本期末	92,184,933.84	92,184,933.84

海富通中证 A500 指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2025年3月25日（基金合同生效日）至2025年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	84,793,807.69	84,793,807.69
本期申购	2,410,336.54	2,410,336.54
本期赎回（以“-”号填列）	-66,103,225.84	-66,103,225.84
本期末	21,100,918.39	21,100,918.39

注：1、申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

2、本基金自 2025 年 3 月 3 日至 2025 年 3 月 21 日期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 232,598,348.48 元，折合为 232,598,348.48 份基金份额（其中 A 类基金份额 147,827,672.68 份，C 类基金份额 84,770,675.80 份）。根据《海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 62,990.90 元在本基金成立后，折合为 62,990.90 份基金份额（其中 A 类基金份额 39,859.01 份，C 类基金份额 23,131.89 份），划入基金份额持有人账户。

3、根据《海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》、《海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》和《海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务公告》的相关规定，本基金于 2025 年 3 月 25 日(基

金合同生效日)至 2025 年 4 月 29 日止期间暂不向投资人开放申购、赎回、转换、定期定额投资业务，自 2025 年 4 月 30 日起开始办理。

6.4.7.8 未分配利润

海富通中证 A500 指数增强 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	3,395,685.88	1,146,949.88	4,542,635.76
本期基金份额交易产生的变动数	-395,847.75	-658,683.26	-1,054,531.01
其中：基金申购款	343,946.16	146,159.88	490,106.04
基金赎回款	-739,793.91	-804,843.14	-1,544,637.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,999,838.13	488,266.62	3,488,104.75

海富通中证 A500 指数增强 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	1,066,146.69	654,533.43	1,720,680.12
本期基金份额交易产生的变动数	-403,462.43	-542,880.42	-946,342.85
其中：基金申购款	52,690.55	8,354.84	61,045.39
基金赎回款	-456,152.98	-551,235.26	-1,007,388.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	662,684.26	111,653.01	774,337.27

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	23,296.94
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	105,249.67
其他	1,479.03
合计	130,025.64

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	155,364,207.26
减：卖出股票成本总额	153,568,366.07
减：交易费用	180,297.71
买卖股票差价收入	1,615,543.48

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3月25日（基金合同生效日）至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	27,505.88
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,472.16
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	29,978.04

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 2025年3月25日（基金合同生效日）至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	5,601,756.53
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,536,785.84
减：应计利息总额	62,498.53
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	2,472.16

6.4.7.12 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年3月25日（基金合同生效日）至2025年6月30日
股指期货投资收益（税前）	1,705,360.00
减：股指期货差价收入应缴纳增值税额	49,670.68
减：交易费用	2,570.78
合计	1,653,118.54

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年3月25日（基金合同生效日）至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,430,383.29
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	1,430,383.29

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年3月25日（基金合同生效日）至2025年6月30日
1.交易性金融资产	1,827,583.31
——股票投资	1,824,125.47
——债券投资	3,457.84
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-26,100.00
——权证投资	-
——股指期货	-26,100.00
4.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	1,801,483.31

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年3月25日（基金合同生效日）至2025年6月30日
基金赎回费收入	1,081.74
合计	1,081.74

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年3月25日（基金合同生效日）至2025年6月30日
审计费用	15,637.86
信息披露费	34,751.78
证券出借违约金	-
银行划款手续费	2,414.96
开户费	400.00

合计	53,204.60
----	-----------

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2资产负债表日后事项

截至本财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）于 2025 年 1 月 17 日出具《关于同意国泰君安证券股份有限公司吸收合并海通证券股份有限公司并募集配套资金注册、核准国泰君安证券股份有限公司吸收合并海通证券股份有限公司、海富通基金管理有限公司变更主要股东及实际控制人、富国基金管理有限公司变更主要股东、海通期货股份有限公司变更主要股东及实际控制人的批复》（证监许可〔2025〕96 号）核准，国泰君安证券股份有限公司吸收合并海通证券股份有限公司。自本次吸收合并交割日（即 2025 年 3 月 14 日）起，合并后的国泰君安证券股份有限公司（后更名为“国泰海通证券股份有限公司”）承继及承接海通证券股份有限公司的全部资产、负债、业务、人员、合同、资质及其他一切权利与义务，海通证券股份有限公司所持海富通基金管理有限公司（以下简称“海富通基金”）股权亦归属于国泰海通证券股份有限公司，即国泰海通证券股份有限公司成为海富通基金的主要股东，上海国际集团有限公司成为海富通基金实际控制人。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
海富通基金管理有限公司(“海富通”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司(“浦发银行”)	基金托管人、基金销售机构
国泰海通证券股份有限公司(“国泰海通证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2025年3月25日（基金合同生效日）至2025年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例

国泰海通证券	410,462,684.73	100.00%
--------	----------------	---------

注：基金合同成立于 2025 年 3 月 25 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易，基金合同成立于 2025 年 3 月 25 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期			
	2025年3月25日（基金合同生效日）至2025年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰海通证券	76,297.44	100.00%	73,547.31	100.00%

注：1.上述佣金按协议约定的佣金率计算，佣金率由协议签订方参考市场价格确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金管理人提供的证券投资研究服务等。

2.根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。公司的该类佣金协议符合《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》。

3.基金合同成立于 2025 年 3 月 25 日，上年度可比期间无比较数据。

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3月25日（基金合同生效日）至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	380,012.11
其中：应支付销售机构的客户维护费	151,475.54
应支付基金管理人的净管理费	228,536.57

注：1、支付基金管理人海富通基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值 x0.80%/当年天数。

2、基金合同成立于 2025 年 03 月 25 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年3月25日（基金合同生效日）至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	47,501.53

注：1、支付基金托管人浦发银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值 x0.10%/当年天数。

2、基金合同成立于 2025 年 03 月 25 日，上年度可比期间无比较数据。

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3月25日（基金合同生效日）至2025年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通中证 A500 指数增强 A	海富通中证 A500 指数增强 C	合计
浦发银行	-	44,636.84	44,636.84
国泰海通证券	-	39.16	39.16
合计	-	44,676.00	44,676.00

注：1、本基金 A 类份额不收取销售服务费，C 类份额的基金销售服务费年费率为 0.40%，基金销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.40%年费率计提，逐日累计至每月月底,按月支付。销售服务费的计算方法如下：日销售服务费＝前一日 C 类份额的基金资产净值 x0.40%/当年天数。

2、基金合同成立于 2025 年 03 月 25 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易，基金合同成立于 2025 年 3 月 25 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期末未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务，基金合同成立于 2025 年 3 月 25 日，上年度可比期间无比较数据。

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

本基金本报告期末未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务，基金合同成立于 2025 年 3 月 25 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

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

注：基金管理人投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定，基金合同成立于 2025 年 03 月 25 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末未持有本基金，基金合同成立于 2025 年 03 月 25 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年3月25日（基金合同生效日）至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
浦发银行	177,399.97	23,296.94

注：基金合同成立于 2025 年 3 月 25 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券，基金合同成立于 2025 年 03 月 25 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金在本报告期内无须作说明的其他关联交易事项，基金合同成立于 2025 年 3 月 25 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

6.4.12 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期内未发生转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征

通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于 2025 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券。基金合同成立于 2025 年 03 月 25 日，上年度可比期间无比较数据。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元	
短期信用评级	本期末 2025年6月30日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	6,035,726.29
合计	6,035,726.29

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。未评级部分一般为国债、政策性金融债、央票、无第三方评级机构评级的债券。

2、基金合同成立于 2025 年 03 月 25 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	177,399.97	-	-	-	177,399.97
结算备付金	4,577,764.15	-	-	-	4,577,764.15
存出保证金	49,841.57	-	-	559,728.00	609,569.57
交易性金融资产	6,035,726.29	-	-	103,354,236.87	109,389,963.16
买入返售金融资产	3,000,000.00	-	-	-	3,000,000.00
应收清算款	-	-	-	1,908,265.32	1,908,265.32
应收申购款	-	-	-	1,342,564.79	1,342,564.79
资产总计	13,840,731.98	-	-	107,164,794.98	121,005,526.96
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,205,140.88	3,205,140.88
应付管理人报酬	-	-	-	81,727.40	81,727.40
应付托管费	-	-	-	10,215.95	10,215.95
应付销售服务费	-	-	-	8,367.30	8,367.30
应交税费	-	-	-	27,844.23	27,844.23
其他负债	-	-	-	123,936.95	123,936.95
负债总计	-	-	-	3,457,232.71	3,457,232.71

利率敏感度缺口	13,840,731.98	-	-	103,707,562.27	117,548,294.2 5
---------	---------------	---	---	----------------	--------------------

注：1、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。

2、基金合同成立于 2025 年 03 月 25 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变				
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）			
		本期末 2025 年 6 月 30 日			
	市场利率上升 25 个基点	-1,005.91			
	市场利率下降 25 个基点	1,008.57			

注：基金合同成立于 2025 年 03 月 25 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，本基金一方面采用指数化被动投资策略以追求有效跟踪标的指数，避免大幅偏离标的指数；另一方面采用量化模型调整投资组合，力求实现高于标的指数的投资收益。本基金运用的量化投资模型借鉴国际一流定量分析的应用经验，利用多因子 alpha 模型预测股票超额回报，在有效风险控制及交易成本最低化的基础上优化投资组合。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票及存托凭证投资比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末	
	2025 年 6 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	103,354,236.87	87.92
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	103,354,236.87	87.92

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 6.4.1)以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2025 年 6 月 30 日
	1.业绩比较基准上升 5%	5,699,966.10
	2.业绩比较基准下降 5%	-5,699,966.10

注：基金合同成立于 2025 年 03 月 25 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末
	2025 年 6 月 30 日
第一层次	103,354,236.87

第二层次	6,035,726.29
第三层次	-
合计	109,389,963.16

注：基金合同成立于 2025 年 3 月 25 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不会将相关股票和债券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2025 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。基金合同成立于 2025 年 3 月 25 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、买入返售金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	103,354,236.87	85.41
	其中：股票	103,354,236.87	85.41
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,035,726.29	4.99
	其中：债券	6,035,726.29	4.99
	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	3,000,000.00	2.48
	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	4,755,164.12	3.93
8	其他各项资产	3,860,399.68	3.19
9	合计	121,005,526.96	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

7.2.1.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	3,113,200.00	2.65
C	制造业	60,346,369.71	51.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,563,150.00	3.03
E	建筑业	1,841,515.00	1.57
F	批发和零售业	141,900.00	0.12
G	交通运输、仓储和邮政业	2,312,467.00	1.97
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,213,825.00	6.99
J	金融业	8,678,256.00	7.38
K	房地产业	474,457.00	0.40
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,183,870.00	1.86
N	水利、环境和公共设施管理业	1,264,648.00	1.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,672,320.00	1.42

R	文化、体育和娱乐业	182,932.00	0.16
S	综合	-	-
	合计	93,988,909.71	79.96

7.2.1.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 （%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	4,144,481.16	3.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	36,475.00	0.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	5,056,451.00	4.30
K	房地产业	127,920.00	0.11
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	9,365,327.16	7.97

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	16,300	4,111,186.00	3.50
2	600519	贵州茅台	2,000	2,819,040.00	2.40
3	000333	美的集团	36,700	2,649,740.00	2.25
4	603259	药明康德	31,400	2,183,870.00	1.86
5	000725	京东方 A	517,000	2,062,830.00	1.75
6	601728	中国电信	250,900	1,944,475.00	1.65
7	600900	长江电力	63,700	1,919,918.00	1.63
8	000063	中兴通讯	58,000	1,884,420.00	1.60
9	300274	阳光电源	27,300	1,850,121.00	1.57
10	601766	中国中车	255,000	1,795,200.00	1.53
11	000100	TCL 科技	410,300	1,776,599.00	1.51
12	601658	邮储银行	311,000	1,701,170.00	1.45
13	300015	爱尔眼科	134,000	1,672,320.00	1.42
14	601600	中国铝业	236,700	1,666,368.00	1.42
15	601668	中国建筑	285,800	1,649,066.00	1.40
16	002340	格林美	259,400	1,647,190.00	1.40
17	601360	三六零	153,800	1,568,760.00	1.33
18	002001	新和成	73,100	1,554,837.00	1.32
19	600372	中航机载	128,000	1,543,680.00	1.31
20	300017	网宿科技	142,700	1,529,744.00	1.30
21	600219	南山铝业	389,800	1,492,934.00	1.27
22	601318	中国平安	26,800	1,486,864.00	1.26
23	300699	光威复材	46,900	1,485,323.00	1.26
24	002241	歌尔股份	62,500	1,457,500.00	1.24
25	603993	洛阳钼业	173,000	1,456,660.00	1.24
26	000938	紫光股份	60,500	1,451,395.00	1.23
27	603799	华友钴业	39,100	1,447,482.00	1.23
28	601398	工商银行	181,600	1,378,344.00	1.17
29	600989	宝丰能源	84,900	1,370,286.00	1.17
30	002415	海康威视	48,600	1,347,678.00	1.15
31	002493	荣盛石化	160,900	1,332,252.00	1.13
32	002841	视源股份	38,200	1,321,720.00	1.12
33	000733	振华科技	26,245	1,313,562.25	1.12
34	601857	中国石油	153,400	1,311,570.00	1.12
35	002007	华兰生物	83,030	1,301,080.10	1.11

36	600036	招商银行	28,300	1,300,385.00	1.11
37	600699	均胜电子	74,500	1,299,280.00	1.11
38	603833	欧派家居	22,500	1,270,125.00	1.08
39	002266	浙富控股	410,600	1,264,648.00	1.08
40	600905	三峡能源	284,800	1,213,248.00	1.03
41	002202	金风科技	113,200	1,160,300.00	0.99
42	601288	农业银行	191,700	1,127,196.00	0.96
43	600104	上汽集团	64,000	1,027,200.00	0.87
44	300088	长信科技	168,200	1,002,472.00	0.85
45	002352	顺丰控股	19,900	970,324.00	0.83
46	000858	五粮液	7,500	891,750.00	0.76
47	000792	盐湖股份	51,800	884,744.00	0.75
48	300413	芒果超媒	38,200	833,524.00	0.71
49	002463	沪电股份	18,900	804,762.00	0.68
50	000338	潍柴动力	51,800	796,684.00	0.68
51	002508	老板电器	39,500	750,895.00	0.64
52	000538	云南白药	13,400	747,586.00	0.64
53	300628	亿联网络	19,700	684,772.00	0.58
54	601919	中远海控	45,500	684,320.00	0.58
55	600050	中国联通	127,200	679,248.00	0.58
56	688256	寒武纪	800	481,200.00	0.41
57	001979	招商蛇口	54,100	474,457.00	0.40
58	002624	完美世界	29,300	444,481.00	0.38
59	605499	东鹏饮料	1,400	439,670.00	0.37
60	600030	中信证券	15,000	414,300.00	0.35
61	601166	兴业银行	16,500	385,110.00	0.33
62	601328	交通银行	42,800	342,400.00	0.29
63	600919	江苏银行	27,400	327,156.00	0.28
64	600887	伊利股份	11,700	326,196.00	0.28
65	605117	德业股份	5,800	305,428.00	0.26
66	601216	君正集团	51,700	285,384.00	0.24
67	300124	汇川技术	4,300	277,651.00	0.24
68	002236	大华股份	16,900	268,372.00	0.23
69	002230	科大讯飞	5,400	258,552.00	0.22
70	600690	海尔智家	10,100	250,278.00	0.21
71	300433	蓝思科技	10,800	240,840.00	0.20
72	603816	顾家家居	9,000	229,680.00	0.20
73	002625	光启技术	5,700	227,886.00	0.19
74	000625	长安汽车	17,700	225,852.00	0.19
75	600028	中国石化	38,000	214,320.00	0.18
76	600584	长电科技	6,300	212,247.00	0.18
77	000988	华工科技	4,500	211,545.00	0.18
78	600795	国电电力	43,200	209,088.00	0.18
79	601872	招商轮船	33,300	208,458.00	0.18

80	600839	四川长虹	20,783	202,010.76	0.17
81	002460	赣锋锂业	5,900	199,243.00	0.17
82	301236	软通动力	3,600	196,704.00	0.17
83	002129	TCL 中环	25,400	195,072.00	0.17
84	002414	高德红外	18,800	192,700.00	0.16
85	002384	东山精密	5,100	192,627.00	0.16
86	601868	中国能建	86,300	192,449.00	0.16
87	300003	乐普医疗	13,800	190,164.00	0.16
88	600085	同仁堂	5,200	187,512.00	0.16
89	600549	厦门钨业	8,900	186,188.00	0.16
90	002938	鹏鼎控股	5,800	185,774.00	0.16
91	600498	烽火通信	8,800	185,064.00	0.16
92	001965	招商公路	15,400	184,800.00	0.16
93	600312	平高电气	12,000	184,680.00	0.16
94	300014	亿纬锂能	4,000	183,240.00	0.16
95	300182	捷成股份	33,200	182,932.00	0.16
96	600497	驰宏锌锗	34,400	181,976.00	0.15
97	300296	利亚德	29,600	180,560.00	0.15
98	000708	中信特钢	15,300	179,928.00	0.15
99	600535	天士力	11,300	176,845.00	0.15
100	000630	铜陵有色	52,300	174,682.00	0.15
101	000999	华润三九	5,520	172,665.60	0.15
102	002594	比亚迪	500	165,955.00	0.14
103	000157	中联重科	22,400	161,952.00	0.14
104	002185	华天科技	14,900	150,490.00	0.13
105	002475	立讯精密	4,200	145,698.00	0.12
106	600637	东方明珠	19,100	142,677.00	0.12
107	600335	国机汽车	22,000	141,900.00	0.12
108	002709	天赐材料	7,700	139,524.00	0.12
109	600406	国电南瑞	6,000	134,460.00	0.11
110	601899	紫金矿业	6,700	130,650.00	0.11
111	601985	中国核电	13,000	121,160.00	0.10
112	601006	大秦铁路	18,000	118,800.00	0.10
113	000001	平安银行	9,600	115,872.00	0.10
114	688041	海光信息	800	113,032.00	0.10
115	003816	中国广核	27,400	99,736.00	0.08
116	300059	东方财富	4,300	99,459.00	0.08
117	000651	格力电器	2,100	94,332.00	0.08
118	688235	百济神州	400	93,456.00	0.08
119	601018	宁波港	23,200	84,912.00	0.07
120	688063	派能科技	1,800	81,144.00	0.07
121	600482	中国动力	2,900	66,903.00	0.06
122	000425	徐工机械	8,200	63,714.00	0.05
123	600115	中国东航	15,100	60,853.00	0.05

124	600276	恒瑞医药	1,000	51,900.00	0.04
125	600362	江西铜业	2,200	51,546.00	0.04
126	002456	欧菲光	4,200	49,770.00	0.04
127	000568	泸州老窖	300	34,020.00	0.03
128	600352	浙江龙盛	1,600	16,256.00	0.01
129	600760	中航沈飞	200	11,724.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002939	长城证券	149,600	1,253,648.00	1.07
2	601688	华泰证券	69,600	1,239,576.00	1.05
3	688001	华兴源创	46,908	1,185,365.16	1.01
4	600016	民生银行	245,200	1,164,700.00	0.99
5	601009	南京银行	80,400	934,248.00	0.79
6	603696	安记食品	53,600	587,992.00	0.50
7	300509	新美星	64,200	549,552.00	0.47
8	688711	宏微科技	29,000	510,110.00	0.43
9	601995	中金公司	7,500	265,200.00	0.23
10	002695	煌上煌	25,600	240,640.00	0.20
11	600109	国金证券	22,700	199,079.00	0.17
12	603808	歌力思	21,000	174,300.00	0.15
13	002587	奥拓电子	26,100	168,345.00	0.14
14	002687	乔治白	33,500	155,440.00	0.13
15	603679	华体科技	10,900	154,998.00	0.13
16	000838	财信发展	49,200	127,920.00	0.11
17	002038	双鹭药业	17,100	121,239.00	0.10
18	002681	奋达科技	14,800	100,196.00	0.09
19	300735	光弘科技	3,600	90,360.00	0.08
20	300289	利德曼	8,800	45,760.00	0.04
21	600897	厦门空港	2,500	36,475.00	0.03
22	300162	雷曼光电	4,700	35,720.00	0.03
23	688625	呈和科技	800	24,464.00	0.02

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	5,280,486.00	4.49
2	601728	中国电信	4,819,465.00	4.10
3	300750	宁德时代	4,637,950.36	3.95
4	002415	海康威视	4,144,497.52	3.53
5	000338	潍柴动力	3,861,983.00	3.29
6	600900	长江电力	3,660,762.00	3.11
7	000333	美的集团	3,609,949.00	3.07
8	600030	中信证券	3,375,380.00	2.87
9	002352	顺丰控股	3,204,134.00	2.73
10	000858	五粮液	2,897,233.00	2.46
11	000651	格力电器	2,885,998.00	2.46
12	601857	中国石油	2,804,527.00	2.39
13	001979	招商蛇口	2,789,651.00	2.37
14	300015	爱尔眼科	2,743,691.00	2.33
15	601398	工商银行	2,657,561.00	2.26
16	603799	华友钴业	2,603,589.00	2.21
17	600104	上汽集团	2,575,289.00	2.19
18	600887	伊利股份	2,563,201.00	2.18
19	000792	盐湖股份	2,525,838.00	2.15
20	603259	药明康德	2,473,656.00	2.10
21	000001	平安银行	2,423,949.00	2.06
22	002202	金风科技	2,389,724.00	2.03
23	601989	中国重工	2,378,493.00	2.02
24	000725	京东方 A	2,363,178.00	2.01
25	000063	中兴通讯	2,351,972.00	2.00

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

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	000338	潍柴动力	3,054,115.00	2.60
2	600030	中信证券	3,001,244.00	2.55
3	601728	中国电信	2,883,831.00	2.45
4	000651	格力电器	2,732,748.00	2.32
5	002415	海康威视	2,645,663.68	2.25
6	000001	平安银行	2,437,067.00	2.07
7	601989	中国重工	2,404,741.00	2.05
8	002352	顺丰控股	2,394,527.00	2.04
9	001979	招商蛇口	2,296,832.00	1.95
10	688009	中国通号	2,250,645.45	1.91
11	600352	浙江龙盛	2,213,102.00	1.88
12	600519	贵州茅台	2,207,751.00	1.88

13	600887	伊利股份	2,133,683.00	1.82
14	600362	江西铜业	2,090,474.00	1.78
15	600167	联美控股	2,048,084.00	1.74
16	300595	欧普康视	2,009,414.00	1.71
17	000858	五粮液	1,996,495.00	1.70
18	600900	长江电力	1,904,482.00	1.62
19	000625	长安汽车	1,825,980.00	1.55
20	300003	乐普医疗	1,754,639.00	1.49

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	255,098,477.47
卖出股票收入（成交）总额	155,364,207.26

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	6,035,726.29	5.13
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,035,726.29	5.13

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	019749	24 国债 15	59,600	6,035,726.29	5.13

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	609,569.57
2	应收清算款	1,908,265.32
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,342,564.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,860,399.68

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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

			持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
海富通中证 A500 指数增强 A	422	218,447.71	30,898,195.28	33.52%	61,286,738.56	66.48%
海富通中证 A500 指数增强 C	1,108	19,044.15	3,258.90	0.02%	21,097,659.49	99.98%
合计	1,530	74,043.04	30,901,454.18	27.28%	82,384,398.05	72.72%

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人 员持有本基金	海富通中证 A500 指数 增强 A	2,993.70	0.0032%
	海富通中证 A500 指数 增强 C	234,769.33	1.1126%
	合计	237,763.03	0.2099%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基 金投资和研究部门负责人 持有本开放式基金	海富通中证 A500 指数增 强 A	0
	海富通中证 A500 指数增 强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开 放式基金	海富通中证 A500 指数增 强 A	0
	海富通中证 A500 指数增 强 C	10~50
	合计	10~50

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持 有 份 额 占 基 金 总	发起份额总数	发 起 份 额 占 基 金 总	发起份额 承诺持有 期限
----	--------	--------------------	--------	--------------------	--------------------

		份额比例		份额比例	
基金管理人固有资金	10,002,083.54	8.83%	10,002,083.54	8.83%	不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,002,083.54	8.83%	10,002,083.54	8.83%	-

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通中证 A500 指数增强 A	海富通中证 A500 指数增强 C
基金合同生效日（2025 年 3 月 25 日）基金份额总额	147,867,531.69	84,793,807.69
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	22,245,516.53	2,410,336.54
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	77,928,114.38	66,103,225.84
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	92,184,933.84	21,100,918.39

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：

2025 年 4 月 23 日，海富通基金管理有限公司发布公告，谢乐斌先生自 2025 年 4 月 21 日起担任公司董事长，路颖女士因工作调整不再担任公司董事长。

基金托管人：

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来聘请毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务。

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，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金托管人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	
国泰海通证券	2	410,462,684.73	100.00%	76,297.44	100.00%	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-

注：1、报告期内本基金租用券商交易单元没有发生变更。

2、交易单元的选择标准：

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

3、交易单元的选择程序：

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

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

（3）基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	回购交易	权证交易
------	------	------	------

	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期回购成交总额的 比例	成交金额	占当期权证成交总额的 比例
国泰海通证券	17,032,586.00	100.00%	2,103,960,000.00	100.00%	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	海富通基金管理有限公司关于变更主要股东及实际控制人事项获得中国证券监督管理委员会批复的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-01-21
2	海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金份额发售公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-02-21
3	海富通基金管理有限公司关于海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金新增销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-02-28
4	海富通基金管理有限公司关于海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金新增海通证券股份有限公司为销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-01
5	海富通基金管理有限公司关于海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金新增销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-06
6	海富通基金管理有限公司关于海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金新增销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-07
7	海富通基金管理有限公司关于公司主要股东和实际控制人变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-18
8	海富通基金管理有限公司关于海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金新增销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-20
9	海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同生效公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-26
10	海富通基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况 (2024 年	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金	2025-03-31

	下半年度)	电子披露网站	
11	海富通基金管理有限公司关于董事长变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-04-23
12	海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-04-25
13	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增平安银行股份有限公司（行 E 通）为销售平台的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-05-30
14	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海华夏财富投资管理有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-06-04
15	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华宝证券股份有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-06-17

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

海富通基金管理有限公司成立于 2003 年 4 月，是中国首批获准成立的中外合资基金管理公司。

从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 131 只公募基金。截至 2025 年 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 2161 亿元人民币。

海富通是国家人力资源和社会保障部首批企业年金基金投资管理人，是首批获得特定客户资产管理业务资格的基金管理公司。2010 年 12 月，海富通被全国社会保障基金理事会选聘为境内委托投资管理人。2012 年 9 月，中国保监会公告确认海富通为首批保险资金投资管理人之一。2014 年 8 月，海富通全资子公司上海富诚海富通资产管理有限公司正式开业，获准开展特定客户资产管理服务。2016 年 12 月，海富通被全国社会保障基金理事会选聘为首批基本养老保险基金投资管理人。

2021 年 7 月，海富通内需热点混合型证券投资基金蝉联《上海证券报》颁发的“金基金·偏股混合型基金三年期奖”。2021 年 9 月，由《中国证券报》主办的第十八届“中国基金业金牛奖”揭晓，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“三年期开放式混合型持续优胜金牛基金”。

2022 年 7 月，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获《证券时报》颁发的“五年持续回报灵活配置混合型明星基金奖”。2022 年 8 月，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获《中国证券报》颁发的“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获“三年期开放式混合型持续优胜金牛基金”。2022 年 9 月，海富通荣获中国保险资产管理业协会颁发的“IAMAC 推介 2021 年度保险资产管理业最受欢迎投资业务合作机构——最具进取基金公司”。2022 年 11 月，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获《上海证券报》颁发的“金基金·灵活配置型基金三年期奖”，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“金基金·偏股混合型基金五年期奖”。

2023 年 3 月，海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金荣获上海证券交易所颁发的“上交所 2022 年度债券旗舰 ETF”。2023 年 6 月，海富通收益增长证券投资基金荣获《证券时报》颁发的“五年持续回报灵活配置型明星基金奖”。2023 年 8 月，海富通荣获《上海证券报》颁发的“上证·中国基金投教创新案例奖”。

2024 年 12 月，海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金荣获《中国证券报》颁发的“债券型 ETF 典型精品案例”。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一)中国证监会批准设立海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金的文件
- (二)海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同
- (三)海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书
- (四)海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金托管协议
- (五)中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件
- (六)法律法规及中国证监会规定的其它文件

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司
二〇二五年八月三十日