

海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金

2026 年第 2 季度报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年七月二十一日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 7 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	海富通中证 A500 指数增强
基金主代码	023367
交易代码	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
报告期末基金份额总额	392,968,317.13 份
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。	
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	
下属分级基金的基金简	海富通中证 A500 指数增强 A	海富通中证 A500 指数增强 C

称		
下属分级基金的交易代 码	023367	023368
报告期末下属分级基金 的份额总额	249,544,547.59 份	143,423,769.54 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2026 年 4 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	海富通中证 A500 指 数增强 A	海富通中证 A500 指 数增强 C
1.本期已实现收益	16,601,208.86	6,377,624.64
2.本期利润	49,707,178.36	20,816,882.90
3.加权平均基金份额本期利润	0.1911	0.1745
4.期末基金资产净值	350,502,058.25	200,435,666.78
5.期末基金份额净值	1.4046	1.3975

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。

3.2 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

1、海富通中证 A500 指数增强 A：

阶段	净值增长 率①	净值增长 率标准差	业绩比较 基准收益	业绩比较 基准收益	①—③	②—④
----	------------	--------------	--------------	--------------	-----	-----

		②	率③	率标准差 ④		
过去三个月	13.27%	1.43%	13.54%	1.34%	-0.27%	0.09%
过去六个月	13.92%	1.32%	11.34%	1.22%	2.58%	0.10%
过去一年	35.34%	1.11%	34.41%	1.09%	0.93%	0.02%
自基金合同生效起至今	40.46%	1.01%	33.58%	1.09%	6.88%	-0.08%

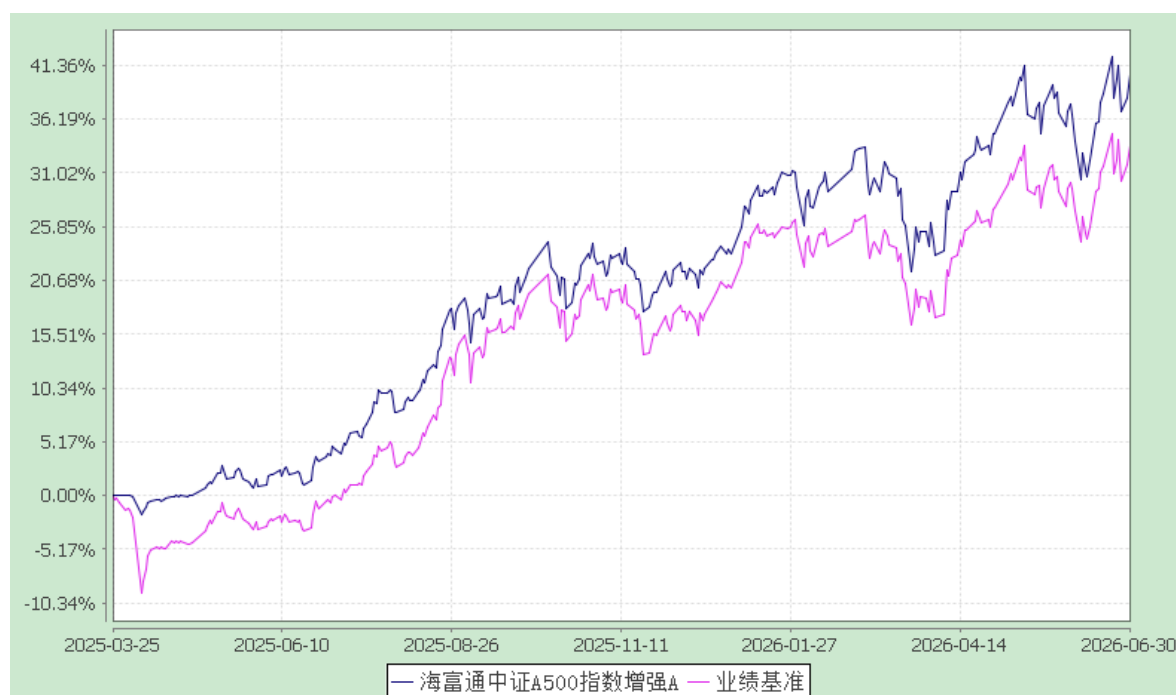
2、海富通中证 A500 指数增强 C：

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

3.2.2 自基金合同生效以来基金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
 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
 (2025 年 3 月 25 日至 2026 年 6 月 30 日)

1. 海富通中证 A500 指数增强 A：



2. 海富通中证 A500 指数增强 C:



注：本基金合同于 2025 年 3 月 25 日生效，按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
李自悟	本基金的基金经理；量化投资部副总监。	2025-12-25	-	18 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。2008 年 4 月至 2010 年 1 月任 MNJ Capital Management 交易员，2010 年 7 月至 2011 年 6 月任 BlackRock 研究员，2011 年 7 月至 2016 年 3 月任国家外汇管理局中央外汇业务中心基金经理，2016 年 3 月至 2019 年 8 月任上海均直资产管理有限公司基金经理，2019 年 9 月至 2022 年 8 月任野村东方国际证券量化投资主管。2022 年 8 月加入海富通基金管理有限公司，现任量化投资部副总监（主持工作）。2023 年 2 月起任海富通中证 500 增强基金经理。2023 年 2 月至 2025 年 3 月兼任海富通量化先锋股票基金经理。2023 年 4 月起兼任海富通阿尔法对冲混合基金经理。2024 年 3 月起兼任海富通中证 2000 增强策略 ETF 基金经理。2024 年 7 月起兼任海富通量化选股混合基金经理。2025 年 3 月起兼任海富通欣益混合基金经理。2025 年 12 月起兼任海富通中证 A500 指数增强基金经理。2026 年 5 月起兼任海富通沪深 300 指数增强基金经理。
朱斌全	本基金的基金经理	2025-03-25	-	19 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。2005 年 7 月至 2006 年 8 月任上海涅柔斯投资管理有限公司美股交易员。2007 年 4 月加入海富通基金管理有限

					公司，历任交易员、高级交易员、量化分析师、投资经理、基金经理助理。2018 年 11 月至 2022 年 8 月任海富通阿尔法对冲混合基金经理。2019 年 10 月至 2022 年 12 月兼任海富通富祥混合基金经理。2019 年 10 月起兼任海富通沪深 300 增强（原海富通富睿混合）、海富通欣益混合的基金经理。2019 年 10 月至 2025 年 5 月兼任海富通量化多因子混合基金经理。2020 年 10 月至 2025 年 8 月兼任海富通欣享混合的基金经理。2020 年 10 月至 2022 年 8 月兼任海富通新内需混合基金经理。2022 年 8 月起兼任海富通安益对冲混合基金经理。2022 年 12 月至 2024 年 4 月兼任海富通量化先锋股票、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	-	7 年	美国密歇根大学定量金融与风险管理硕士，持有基金从业人员资格证书。历任中欧基金管理有限公司风险管理部量化风控岗。2020 年 8 月加入海富通基金管理有限公司，历任量化研究员、量化投资部基金经理助理。2023 年 11 月至 2026 年 1 月任海富通富利三个月持有的基金经理。2023 年 11 月起任海富通沪深 300 增强的基金经理。2023 年 11 月至 2025 年 3 月兼任海富通欣益混合的基金经理。2024 年 10 月至 2025 年 5 月兼任海富通量化多因子混合基金经理。2025 年 1 月起兼任海富通中证 500 指数增强基金经理。

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

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

2、证券从业年限的计算标准：自参加证券行业的相关工作开始计算。

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 公平交易专项说明

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同向交易的样本，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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年二季度，我国国民经济延续总体平稳、保持向新向优的发展态势。结构上，外贸韧性彰显，发展动能向新。从外贸表现来看，出口延续增长态势，其中 AI 相关产业出口保持高增长。产业层面，规模以上高技术制造业增加值呈现较快增长，反映出新兴产业正快速成长，为经济高质量发展提供了有力支撑。尽管二季度国际环境复杂多变，但国内有效实施更加积极有为的宏观政策，经济整体保持平稳运行。

海外经济方面，AI 投资持续拉动全球经济，海外流动性边际偏紧，中东地缘风险迎来阶段性降温。美国科技巨头一季报纷纷上修资本开支计划，带动全球 AI 产业链如高端算力硬件等上游需求大增。与此同时，高油价冲击下全球通胀有所走高，欧央行、日本央行等主要央行已启动加息进程，市场对美联储年内启动加息的预期也有所升温，整体海外流动性环境偏紧。值得关注的是，6 月中旬美伊两国远程签署谅解备忘录，霍尔木兹海峡逐步恢复通航，国际油价从高位显著回落，中东地缘局势迎来阶段性缓和，有助于改善全球风险偏好。

从 A 股市场看，二季度市场震荡走强，结构上 AI 是贯穿始终的核心主线，风格上成长板块大幅领跑。主要指数方面，科创 50 上涨 75.74%，创业板指上涨 36.35%，中证 500 上涨 18.56%，沪深 300 上涨 11.90%。行业板块方面，根据申万一级行业分类，二季度表现靠前的板块是电子、通信、建筑材料、机械设备、基础化工，表现靠后的板块是石油石化、农林牧渔、钢铁、商贸零售、美容护理。市场整体呈现鲜明的成长风格溢价，AI 算力与应用方向的产业链标的表现尤为突出。

本基金坚持通过多因子量化模型优选个股，并严格执行风险预算模型控制组合在风格及行业层面相对基准指数的暴露。二季度市场风格偏向大盘成长，成长因子与动量因子贡献了主要的风格收益，而低波动因子与红利因子表现偏弱。在因子配置上，组合通过因子择时模型适度提升了成长因子和景气度因子的配置权重，同时维持了质量因子的基础暴露以保障组合的稳健性。策略层面，我们动态

调整了趋势跟踪策略与反转策略的配比，在单边风格占优的环境下增强了趋势信号的响应速度，并压缩了反转信号的权重以减少左侧交易的摩擦成本。风险预算模型对组合的风格偏离实施严格约束，在成长因子显著跑赢的背景下，主动控制超额收益的波动率，确保组合在风格持续期间保持稳健的超额信息比率。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通中证 A500 指数增强 A 净值增长率为 13.27%，同期业绩比较基准收益率为 13.54%。海富通中证 A500 指数增强 C 净值增长率为 13.15%，同期业绩比较基准收益率为 13.54%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	507,382,570.05	90.57
	其中：股票	507,382,570.05	90.57
2	固定收益投资	14,234,758.45	2.54
	其中：债券	14,234,758.45	2.54
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	29,992,350.47	5.35
7	其他各项资产	8,606,283.48	1.54

8	合计	560,215,962.45	100.00
---	----	----------------	--------

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	33,474.36	0.01
C	制造业	46,946,192.00	8.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,195,832.01	0.58
E	建筑业	3,187,430.00	0.58
F	批发和零售业	2,398,402.00	0.44
G	交通运输、仓储和邮政业	1,331,784.00	0.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,471,762.98	0.45
J	金融业	3,045,655.00	0.55
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	16,866.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	62,627,398.35	11.37

5.2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	265,408.00	0.05

B	采矿业	27,508,113.00	4.99
C	制造业	316,775,688.50	57.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,495,938.00	0.63
E	建筑业	5,255,377.00	0.95
F	批发和零售业	9,064,628.00	1.65
G	交通运输、仓储和邮政业	8,475,934.00	1.54
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	38,883,799.20	7.06
J	金融业	23,420,185.00	4.25
K	房地产业	85,675.00	0.02
L	租赁和商务服务业	382,889.00	0.07
M	科学研究和技术服务业	5,387,424.00	0.98
N	水利、环境和公共设施管理业	2,004,617.00	0.36
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,818,646.00	0.33
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	1,930,850.00	0.35
	合计	444,755,171.70	80.73

5.2.3 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。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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前十名股票投资明细

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	16,700	21,209,000.00	3.85
2	300750	宁德时代	36,400	14,305,564.00	2.60
3	300502	新易盛	15,140	9,189,980.00	1.67

4	603986	兆易创新	10,400	8,476,000.00	1.54
5	688256	寒武纪	5,114	8,159,642.70	1.48
6	688008	澜起科技	23,525	7,290,397.50	1.32
7	601899	紫金矿业	288,800	7,260,432.00	1.32
8	600519	贵州茅台	5,600	6,638,744.00	1.20
9	002384	东山精密	24,900	6,532,515.00	1.19
10	301308	江波龙	8,600	6,052,680.00	1.10

5.3.2 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前五名股票投资明细

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	301165	锐捷网络	30,300	2,437,635.00	0.44
2	603929	亚翔集成	8,300	2,257,766.00	0.41
3	603283	赛腾股份	27,850	2,255,293.00	0.41
4	001287	中电港	69,700	2,171,155.00	0.39
5	300913	兆龙互连	44,800	2,146,368.00	0.39

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	14,234,758.45	2.58
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	14,234,758.45	2.58

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019827	26 国债 01	60,000	6,038,891.51	1.10
2	019785	25 国债 13	31,000	3,139,138.99	0.57
3	019792	25 国债 19	30,000	3,031,476.99	0.55
4	102310	国债 2513	20,000	2,025,250.96	0.37

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

代码	名称	持仓量	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IF2609	IF2609	3.00	4,364,820.00	60,060.00	-
IC2609	IC2609	1.00	1,752,280.00	148,460.00	-
公允价值变动总额合计(元)					208,520.00
股指期货投资本期收益(元)					665,886.04
股指期货投资本期公允价值变动(元)					537,920.00

注：股指期货投资本期收益中已扣除本期股指期货差价收入应缴纳增值税额。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

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

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,073,630.14
2	应收证券清算款	5,625,661.51
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,906,991.83
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	8,606,283.48

5.11.4 报告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。

5.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 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。

5.11.5.2 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未存在流通受限情况。

§6 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
本报告期期初基金份额总额	307,441,262.78	130,273,407.80
报告期期间基金总申购份额	188,779,462.39	166,009,821.42
减：报告期期间基金总赎回份额	246,676,177.58	152,859,459.68
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	249,544,547.59	143,423,769.54

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况**

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
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,002,083.54	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,002,083.54	-
报告期期末持有的本基金	4.01	-

份额占基金总份额比例 (%)		
-------------------	--	--

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

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

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

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

海富通基金管理有限公司成立于 2003 年 4 月，是中国首批获准成立的中外合资基金管理公司。从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 137 只公募基金。截至 2026 年 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 3108 亿元人民币。

海富通是国家人力资源和社会保障部首批企业年金基金投资管理人。2008 年 3 月，海富通获批从事特定客户资产管理业务。2010 年 12 月，海富通被全国社会保障基金理事会选聘为境内委托投资管理人。2012 年 9 月，中国保险监督管理委员会公告确认海富通为首批保险资金投资管理人。2016 年 12 月，海富通被全国社会保障基金理事会选聘为首批基本养老保险基金投资管理人。

§10 备查文件目录

10.1 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

10.2 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

10.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司
二〇二六年七月二十一日