

泰信中证 A500 指数增强型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：泰信基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 28 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
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	5
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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	51
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	51

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	51
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	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12 投资组合报告附注	52
§ 8 基金份额持有人信息	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
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	53
§ 9 开放式基金份额变动	54
§ 10 重大事件揭示	54
10.1 基金份额持有人大会决议	54
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	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4 基金投资策略的改变	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	55
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	55
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	55
10.8 其他重大事件	56
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	56
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	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	57
§ 12 备查文件目录	57
12.1 备查文件目录	57
12.2 存放地点	57
12.3 查阅方式	57

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰信中证 A500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	泰信中证 A500 指数增强	
基金主代码	023981	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 9 月 23 日	
基金管理人	泰信基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	52,740,132.57 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	泰信中证 A500 指数增强 A	泰信中证 A500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	023981	023982
报告期末下属分级基金的份额总额	30,070,729.89 份	22,669,402.68 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,在力求对中证 A500 指数进行有效跟踪的基础上,通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制,力争实现超越标的指数的投资收益,谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为指数增强型产品,在标的指数成份股权重的基础上根据量化模型对行业配置及个股权重等进行主动调整,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%,年化跟踪误差不超过 7.75%,在控制跟踪偏离度和跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率 $\times$ 95%+同期银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金通过指数化投资,争取获得与标的指数相似的总回报,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		泰信基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘小舫	冯萌
	联系电话	021-20899003	021-52629999-213310
	电子邮箱	xxpl@ftfund.com	fengmeng@cib.com.cn
客户服务电话		400-888-5988	95561
传真		021-20899008	021-62159217

注册地址	中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号 37 层	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号 36-37 层	上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼
邮政编码	200120	200120
法定代表人	李高峰	吕家进

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.ftfund.com
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	泰信基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号 36、37 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据 和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	泰信中证 A500 指数增强 A	泰信中证 A500 指数增强 C
本期已实现收益	4,321,899.67	3,591,457.64
本期利润	4,436,992.32	3,833,171.45
加权平均基金份额 本期利润	0.1076	0.1127
本期加权平均净 值利润率	10.17%	10.69%
本期基金份额净 值增长率	10.62%	10.40%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	3,163,076.32	2,306,959.67
期末可供分配基 金份额利润	0.1052	0.1018

期末基金资产净值	33,837,655.25	25,430,390.87
期末基金份额净值	1.1253	1.1218
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	12.53%	12.18%

- 注：1、本基金基金合同于 2025 年 9 月 23 日正式生效。
- 2、所述基金业绩指标不包括基金份额持有人申购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
- 3、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。
- 4、期末可供分配利润是指未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

泰信中证 A500 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	14.38%	1.28%	13.54%	1.34%	0.84%	-0.06%
过去六个月	10.62%	1.18%	11.34%	1.22%	-0.72%	-0.04%
自基金合同生效起至今	12.53%	1.04%	14.96%	1.14%	-2.43%	-0.10%

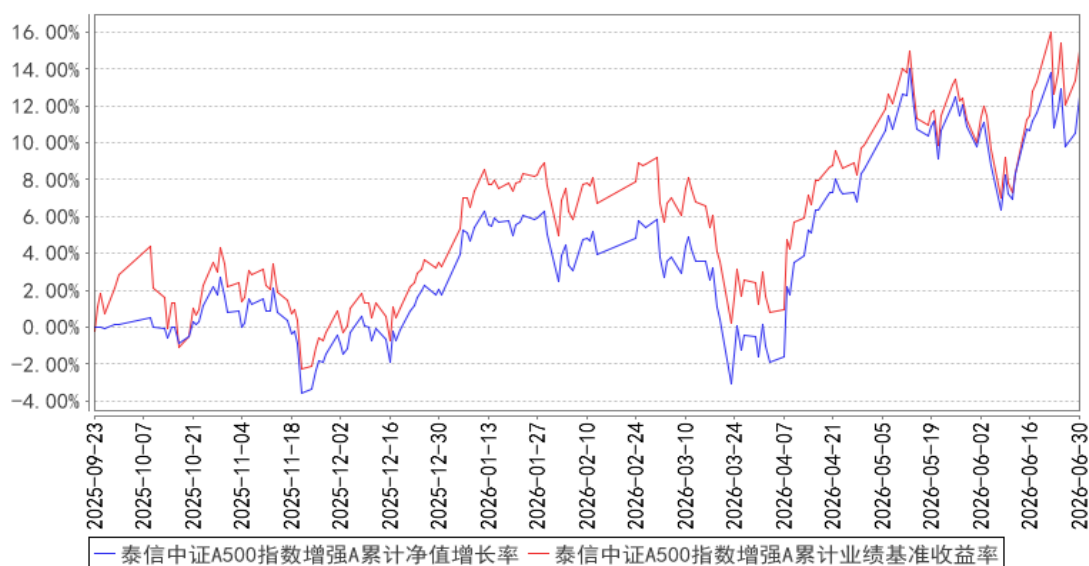
泰信中证 A500 指数增强 C

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	14.27%	1.28%	13.54%	1.34%	0.73%	-0.06%
过去六个月	10.40%	1.18%	11.34%	1.22%	-0.94%	-0.04%
自基金合同生效起至今	12.18%	1.04%	14.96%	1.14%	-2.78%	-0.10%

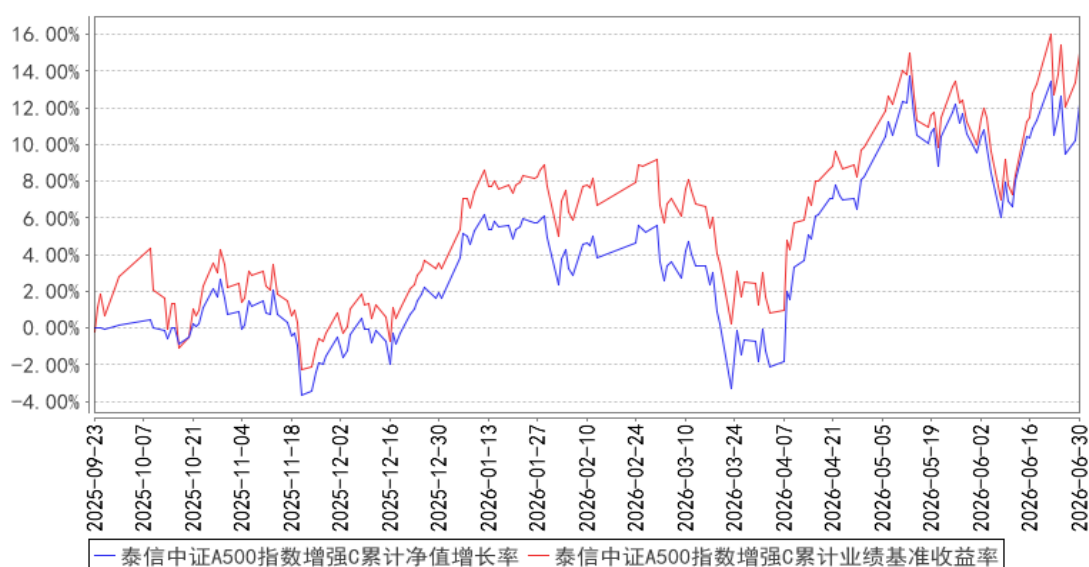
注：本基金的业绩比较基准为：中证 A500 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%

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

泰信中证A500指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



泰信中证A500指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2025 年 9 月 23 日正式生效。

2、基金的投资组合比例为：本基金投资于股票、存托凭证的资产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（均含存托凭证）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国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者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。

§ 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：泰信基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号 37 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号 36、37 层

成立日期：2003 年 5 月 23 日

法定代表人：李高峰

总经理：张秉麟

电话：021-20899188

传真：021-20899008

联系人：徐磊

发展沿革：

泰信基金管理有限公司（First-Trust Fund Management Co., Ltd.）是原山东省国际信托投资有限公司（现更名为山东省国际信托股份有限公司）联合江苏省投资管理有限责任公司、青岛国信实业有限公司（现更名为青岛国信产融控股（集团）有限公司）共同发起设立的基金管理公司。公司于 2002 年 9 月 24 日经中国证券监督管理委员会批准正式筹建，2003 年 5 月 8 日获准开业，是“好人举手”制度下，获准筹建的第一家以信托公司为主发起人的基金管理公司。2021 年 9 月 2 日经中国证券监督管理委员会证监许可[2021]2848 号文核准，山东省国际信托股份有限公司将其持有的 45%股权转让给山东省鲁信投资控股集团有限公司。目前，公司注册资本为 2 亿元人民币，股东为山东省鲁信投资控股集团有限公司、江苏省投资管理有限责任公司、青岛国信产融控股（集团）有限公司。截至 2026 年 6 月末，泰信基金管理有限公司旗下管理共计 40 只开放式基金及多个资产管理计划。

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		
陈颖	泰信医疗服务混合型发起式证券投资	2025 年 9 月 23 日	-	16 年	陈颖女士，研究生学历。曾任职于北京德丰华投资公司研究员、光大证券资产管理有限公司研究员、敦和资产管理有限公司基金经理兼高级分析师、申港证券投资经

	基金基金经理、泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、泰信互联网+主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理、泰信中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理、泰信优质生活混合型证券投资基金基金经理				理。2021 年 12 月加入泰信基金管理有限公司拟任基金经理。2022 年 1 月任泰信医疗服务混合型发起式证券投资基金基金经理，2024 年 5 月任泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2025 年 8 月任泰信互联网+主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2025 年 9 月任泰信中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理，2025 年 11 月任泰信优质生活混合型证券投资基金基金经理。
张海涛	泰信中证 200 指数证券投资基金基金经理、泰信优势增长灵活配置混合型证券投资基金基金经理、泰信双息双利债券型证券投资基金基金经理、泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金基	2025 年 10 月 21 日	-	6 年	张海涛先生，研究生学历。曾任华夏基金管理有限公司资产配置部研究员，北京源峰私募基金管理合伙企业（有限合伙）研究部研究员。2024 年 9 月加入泰信基金管理有限公司，曾任基金经理助理兼研究员，2025 年 1 月任泰信中证 200 指数证券投资基金基金经理，2025 年 1 月任泰信优势增长灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2025 年 1 月任泰信双息双利债券型证券投资基金基金经理，2025 年 1 月任泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金基金经理，2025 年 6 月任泰信智选量化选股混合型发起式证券投资基金基金经理，2025 年 10 月任泰信中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理，2025 年 12 月任泰信中证全指自由现金流指数型证券投资基金基金经理，2026 年 1 月任上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金经理，2026 年 4 月任泰信添瑞债券型证券投资基金基金经理。

	金经理、泰信智选量化选股混合型发起式证券投资基金基金经理、泰信中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理、泰信中证全指自由现金流指数型证券投资基金基金经理、泰信上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金经理、泰信添瑞债券型证券投资基金基金经理				
--	--	--	--	--	--

注：1、任职日期、离任日期分别指根据基金管理人决定确定的聘任日期和解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末本基金基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

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循《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《泰信中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产。本基金管理人在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为，本基

金的投资运作符合有关法规和基金合同的规定。

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

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（中国证监会公告[2011]18号），公司制定了《泰信基金管理有限公司公平交易管理办法》以及《泰信基金管理有限公司异常交易监控与报告管理办法》，适用于所有投资品种，以及所有投资管理活动，涵盖授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各环节，从研究、投资、交易合规性监控，发现可疑交易立即报告，并由风险管理部负责对公平交易情况进行定期和不定期评估。

公司所有研究成果对公司所管理的所有产品公平开放，基金经理严格遵守公平、公正、独立的原则下达投资指令，所有投资指令在集中交易部集中执行，投资交易过程公平公正，投资交易监控贯穿于整个投资过程。

本报告期内，投资交易监控与价差分析未发现本基金与其他基金之间存在利益输送行为，公平交易制度整体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。本报告期内，本基金参与的交易所公开竞价同日反向交易，未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情况，亦无其他异常交易行为。

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

2026 年上半年，A 股市场呈现“指数繁荣、结构剧烈分化”的特征。主要指数震荡上行，市场交投活跃，半年度总成交额创历史新高。收益高度集中于科技成长板块，AI 科技成为贯穿上半年的核心主线，半导体、光通信等硬件端强势领涨，相关行业指数涨幅显著领先；而大消费、商贸零售、地产链等传统板块持续承压。资金结构方面，大盘龙头股优势持续强化，中小市值品种则整体表现偏弱。总体而言，2026 年上半年 A 股市场科技成长大幅领跑，结构性牛市特征突出。这一格局深刻反映了宏观经济转型与新质生产力政策导向的叠加影响。

本基金将继续坚持系统化投资的运作思路，依托量化多因子模型开展投资决策。我们将勤勉尽责、持续打磨量化模型，

力争实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末泰信中证 A500 指数增强 A 基金份额净值为 1.1253 元,本报告期基金份额净值增长率为 10.62%;截止本报告期末泰信中证 A500 指数增强 C 基金份额净值为 1.1218 元,本报告期基金份额净值增长率为 10.40%;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

展望 2026 年下半年,宏观经济有望延续平稳运行与温和修复态势,国内流动性环境整体保持充裕,市场核心驱动力将逐步由估值扩张切换至盈利兑现,行情或从明显分化走向再平衡。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定,保证基金估值的公平、合理,有效维护投资人的利益,本公司建立估值委员会,负责本公司基金估值业务的决策和评价、与基金估值业务相关的信息披露规定等工作。

本公司管理的基金日常估值由公司清算会计部负责。清算会计部完成估值后,将估值结果以合同约定的形式发送基金托管人,基金托管人按法律法规、《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核,复核无误后,由管理人按约定对外公布;月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。本公司在采用估值政策和程序时,应当充分考虑参与估值流程各方及人员的经验、专业胜任能力和独立性,通过建立估值委员会、参考行业协会估值意见、参考独立第三方机构估值数据等一种或多种方式的有效结合,减少或避免估值偏差的发生。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

一、关于利润分配的约定:

1、基金管理人可对基金相对业绩比较基准的超额收益率或基金的可供收益分配利润进行评价,在符合收益分配相关规定的前提下,基金管理人可进行收益分配;

2、在符合有关基金分红条件的前提下,基金管理人可以根据实际情况进行收益分配,具体分配方案以公告为准,若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;

3、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相应类别的基金份额进行再投资,且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

4、本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权,由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费,C 类基金份额收取销售服务费,各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同;

5、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

二、本报告期本基金未进行利润分配。

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

无

§ 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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本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

报告期内，本托管人根据自身能够获取的数据和信息，依据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人根据自身能够获取的数据和信息，认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：泰信中证 A500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	2,965,713.07	1,876,739.46
结算备付金		2,899,920.75	6,162,474.18
存出保证金		368,680.80	-
交易性金融资产	6.4.7.2	54,890,971.51	113,084,246.18
其中：股票投资		54,890,971.51	113,084,246.18

基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		68,442.56	120,651.84
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		61,193,728.69	121,244,111.66
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		1,796,294.95	1,476,529.93
应付管理人报酬		39,857.59	86,987.61
应付托管费		4,982.20	10,873.45
应付销售服务费		8,414.93	21,268.13
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2,102.77	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	74,030.13	85,900.00
负债合计		1,925,682.57	1,681,559.12
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	52,740,132.57	117,595,868.50
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	6,527,913.55	1,966,684.04
净资产合计		59,268,046.12	119,562,552.54
负债和净资产总计		61,193,728.69	121,244,111.66

注： 1、本基金合同生效日为 2025 年 9 月 23 日，2025 年度实际报告期间为 2025 年 9 月 23 日至 2025 年 12 月 31 日。

2、报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 52,740,132.57 份。其中：泰信中证 A500 指数增强 A 份额净值人民币 1.1253 元，基金份额总额 30,070,729.89 份；泰信中证 A500 指数增强 C 份额净值人民币 1.1218 元，基金份额总额 22,669,402.68 份。

6.2 利润表

会计主体：泰信中证 A500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		8,774,486.08
1. 利息收入		5,304.65
其中：存款利息收入	6.4.7.9	5,304.65
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）		8,411,843.61
其中：股票投资收益	6.4.7.10	7,589,681.21
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-
衍生工具收益	6.4.7.14	251,262.19
股利收益	6.4.7.15	570,900.21
以摊余成本计量的金融资产 终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-” 号填列）	6.4.7.16	356,806.46
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	531.36
减：二、营业总支出		504,322.31
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	318,131.60
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	39,766.46
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	71,812.32
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	6. 4. 7. 18	-
7. 税金及附加		905. 80
8. 其他费用	6. 4. 7. 19	73, 706. 13
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		8, 270, 163. 77
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		8, 270, 163. 77
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		8, 270, 163. 77

注：本基金合同生效日为 2025 年 9 月 23 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年，报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：泰信中证 A500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	117, 595, 868. 50	-	1, 966, 684. 04	119, 562, 552. 54
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	117, 595, 868. 50	-	1, 966, 684. 04	119, 562, 552. 54
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-64, 855, 735. 93	-	4, 561, 229. 51	-60, 294, 506. 42
（一）、综合收益总额	-	-	8, 270, 163. 77	8, 270, 163. 77
（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）	-64, 855, 735. 93	-	-3, 708, 934. 26	-68, 564, 670. 19
其中：1. 基金申购款	19, 744, 776. 43	-	1, 124, 825. 38	20, 869, 601. 81

2. 基金赎回款	-84,600,512.36	-	-4,833,759.64	-89,434,272.00
(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)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	52,740,132.57	-	6,527,913.55	59,268,046.12

注：本基金合同生效日为 2025 年 9 月 23 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年，报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

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：

<u>李高峰</u>	<u>段晓旭</u>	<u>顾颖</u>
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

泰信中证 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]538 号《关于准予泰信中证 A500 指数增强型证券投资基金设立的批复》核准，由泰信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《泰信中证 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基金，存续期限为不定期。本基金根据销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额。本基金首次设立募集基金份额为 232,462,348.38 份，经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证，并出具了编号为德师报(验)字(25)第 00322 号验资报告。《泰信中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2025 年 9 月 23 日正式生效。本基金的基金管理人为泰信基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信中证 A500 指数增强型证券投资基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括标的指数的成份股(包括存托凭证)、备选成份股(包括存托凭

证)、其他国内依法发行上市的股票(包含主板、科创板、创业板及其他依法发行上市的股票和存托凭证)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、政府支持机构债券、政府支持债券、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券及其他经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、通知存款以及其他银行存款等)、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权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)。基金的投资组合比例为:本基金投资于股票、存托凭证的资产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(均含存托凭证)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国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,本基金应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为中证 A500 指数收益率 $\times$ 95%+同期银行活期存款利率(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、应用指南、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”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2026 年 1 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日上海交易所发布的《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳交易所发布的《关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《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》、财税[2016]36 号《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]140 号《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《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》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1)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；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、债券免征增值税。

2)对证券投资基金取得的自 2025 年 8 月 8 日之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复缴纳增值税；取得的在 2025 年 8 月 8 日之前已发行的国债、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。

3)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，暂不计缴企业所得税。

4)对基金取得的股票股息红利所得，由上市公司代扣代缴个人所得税；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，股息红利所得暂免征收个人所得税。其中，对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股，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。

5)对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税；自 2023 年 8 月 28 日起，出让方减按 0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。

6)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	2,965,713.07
等于：本金	2,965,504.52
加：应计利息	208.55
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	2,965,713.07

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	51,717,600.33	-	54,890,971.51	3,173,371.18
贵金属投资-金交所	-	-	-	-

黄金合约					
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		51,717,600.33	-	54,890,971.51	3,173,371.18

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	3,084,400.00	-	-	-
其中：股指期货投资	3,084,400.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	3,084,400.00	-	-	-

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
IF2612	IF2612	1.00	1,428,420.00	-780.00
IM2612	IM2612	1.00	1,643,920.00	-11,280.00
合计				-12,060.00
减：可抵销期货暂收款				-12,060.00
净额				-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指/商品/国债期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	73,596.13
其他	434.00
合计	74,030.13

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

泰信中证 A500 指数增强 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	61,619,468.26	61,619,468.26
本期申购	6,494,340.69	6,494,340.69
本期赎回（以“-”号填列）	-38,043,079.06	-38,043,079.06
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	30,070,729.89	30,070,729.89

泰信中证 A500 指数增强 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	55,976,400.24	55,976,400.24
本期申购	13,250,435.74	13,250,435.74
本期赎回（以“-”号填列）	-46,557,433.30	-46,557,433.30
基金拆分/份额折算前	-	-

基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	22,669,402.68	22,669,402.68

注：申购含红利再投、转换入及份额级别调增数，赎回含转换出及份额级别调减数。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

泰信中证 A500 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	28,825.72	1,034,826.46	1,063,652.18
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	28,825.72	1,034,826.46	1,063,652.18
本期利润	4,321,899.67	115,092.65	4,436,992.32
本期基金份额交易产生的变动数	-1,187,649.07	-546,070.07	-1,733,719.14
其中：基金申购款	325,706.21	95,461.40	421,167.61
基金赎回款	-1,513,355.28	-641,531.47	-2,154,886.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,163,076.32	603,849.04	3,766,925.36

泰信中证 A500 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-35,965.57	938,997.43	903,031.86
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-35,965.57	938,997.43	903,031.86
本期利润	3,591,457.64	241,713.81	3,833,171.45
本期基金份额交易产生的变动数	-1,248,532.40	-726,682.72	-1,975,215.12
其中：基金申购款	638,902.78	64,754.99	703,657.77
基金赎回款	-1,887,435.18	-791,437.71	-2,678,872.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,306,959.67	454,028.52	2,760,988.19

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,620.75
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	1,764.96
其他	918.94
合计	5,304.65

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	7,589,681.21
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	7,589,681.21

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出股票成交总额	231,922,034.00
减：卖出股票成本总额	224,113,238.24
减：交易费用	219,114.55
买卖股票差价收入	7,589,681.21

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	251,262.19

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	570,900.21
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	570,900.21

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	368,866.46
股票投资	368,866.46
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-12,060.00
权证投资	-
期货投资	-12,060.00
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	356,806.46

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	531.36
合计	531.36

注：1、本基金的赎回费率按基金持有人持有该部分基金份额的时间分段递减设定，于持有人赎回基金份额时收取，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2、本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分组成，其中赎回费总额的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	14,088.76
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
银行费用	110.00
合计	73,706.13

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期本基金控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
泰信基金管理有限公司	基金管理人
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	基金托管人
山东省鲁信投资控股集团有限公司（“鲁信集团”）	基金管理人的股东
江苏省投资管理有限责任公司	基金管理人的股东
青岛国信产融控股(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海锐懿资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联方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

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	318,131.60
其中：应支付销售机构的客户维护费	133,208.95
应支付基金管理人的净管理费	184,922.65

注：支付基金管理人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：

日基金管理人报酬=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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	39,766.46

注：支付基金托管人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×0.10%÷当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期内未产生应支付关联方的销售服务费。

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

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

本基金本报告期内转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

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**

本基金本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

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

份额单位：份

泰信中证 A500 指数增强 A

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
上海锐懿资产管理有限公司	9,500,477.77	18.01	9,500,477.77	8.08

注：关联方投资本基金的费率按照基金合同和招募说明书规定的确定，符合公允性要求。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
兴业银行	2,965,713.07	2,620.75

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项的说明。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配的情况。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股流通受限	11.18	17.59	94	1,050.92	1,653.46	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股流通受限	21.88	25.52	41	897.08	1,046.32	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股流通受限	17.52	35.92	392	6,867.84	14,080.64	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	92.18	463.15	26	2,396.68	12,041.90	-
688790	昂瑞微	2025 年 12 月 9 日	9 个月	新股流通受限	83.06	126.45	377	31,313.62	47,671.65	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末无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

本基金本报告期末无从事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

本基金本报告期末无因参与转融通证券出借业务而出借的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金是股票型基金，本基金的运作涉及的金融工具主要包括股票投资、债券投资等。与这些金融工具有关的风险，以及本基金的基金管理人管理这些风险所采取的风险管理政策如下所述。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是提升本基金风险调整后收益水平，保证本基金的

基金资产安全，维护基金份额持有人利益。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人风险管理的基本策略是识别和分析本基金运作时本基金面临的各种类型的风险，确定适当的风险容忍度，并及时可靠地对各种风险进行监督，将风险控制在限定的范围之内。本基金目前面临的主要风险包括：市场风险、信用风险和流动性风险。与本基金相关的市场风险主要包括利率风险和市场价格风险。

本基金的基金管理人建立了以全面、独立、互相制约以及定性和定量相结合为原则的，董事会及下设审计、合规与风险控制委员会、督察长、监察稽核部(审计部)和风险管理部等多层次的风险管理组织架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要存在于货币资金、结算备付金、存出保证金、债券投资及其他。

本基金的货币资金存放于本基金的基金托管人兴业银行，与该货币资金相关的信用风险不重大。本基金在证券交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式，以控制相应的信用风险。

对于与债券投资相关的信用风险，本基金的基金管理人通过对投资品种的信用等级评估来选择适当的投资对象，并限制单个投资品种的持有比例来管理信用风险。

于 2026 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(2025 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因市场交易相对不活跃导致基金投资资产无法以适当价格及时变现，进而无法对投资者赎回款或基金其它应付款按时支付的风险。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指没有足够资金以满足到期债务支付的风险。本基金流动性风险来源于开放式基金每日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持有的交易性金融资产分别在证券交易所和银行间同业市场交易，除附注 6.4.12 所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。本基金所持有的金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计

息。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款，设计了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。日常流动性风险管理中，本基金的基金管理人每日监控和预测本基金的流动性指标，通过对投资品种的流动性指标来持续地评估、选择、跟踪和控制基金投资的流动性风险。同时，本基金通过预留一定的现金头寸，并且在需要时可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金，以缓解流动性风险。

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该比例限制）。

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。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%。于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.1291%。

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。于 2026 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值为人民币 56,064,189.67 元，超过经确认的当日净赎回金额。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，包括利率风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是货币资金、债券投资。利率敏感性负债主要是卖出回购金融资产款。本基金的基金管理人日常通过对利率水平的预测、分析收益率曲线及优化利率重定价日组合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 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	2,965,713.07	-	-	-	2,965,713.07
结算备付金	2,899,920.75	-	-	-	2,899,920.75
存出保证金	368,680.80	-	-	-	368,680.80
交易性金融资产	-	-	-	54,890,971.51	54,890,971.51
应收申购款	-	-	-	68,442.56	68,442.56
资产总计	6,234,314.62	-	-	54,959,414.07	61,193,728.69
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,796,294.95	1,796,294.95
应付管理人报酬	-	-	-	39,857.59	39,857.59
应付托管费	-	-	-	4,982.20	4,982.20
应付销售服务费	-	-	-	8,414.93	8,414.93
应交税费	-	-	-	2,102.77	2,102.77
其他负债	-	-	-	74,030.13	74,030.13
负债总计	-	-	-	1,925,682.57	1,925,682.57
利率敏感度缺口	6,234,314.62	-	-	53,033,731.50	59,268,046.12
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,876,739.46	-	-	-	1,876,739.46
结算备付金	6,162,474.18	-	-	-	6,162,474.18
交易性金融资产	-	-	-	113,084,246.18	113,084,246.18
应收申购款	-	-	-	120,651.84	120,651.84
资产总计	8,039,213.64	-	-	113,204,898.02	121,244,111.66
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,476,529.93	1,476,529.93
应付管理人报酬	-	-	-	86,987.61	86,987.61
应付托管费	-	-	-	10,873.45	10,873.45
应付销售服务费	-	-	-	21,268.13	21,268.13
其他负债	-	-	-	85,900.00	85,900.00

负债总计	-	-	-	1,681,559.12	1,681,559.12
利率敏感度缺口	8,039,213.64	-	-	-111,523,338.90	119,562,552.54

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2025 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2025 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。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债券和股票，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金在构建资产配置和基金资产投资组合的基础上，通过建立事前和事后跟踪误差的方式，对基金资产的市场价格风险进行管理。

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	54,890,971.51	92.61	113,084,246.18	94.58
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	54,890,971.51	92.61	113,084,246.18	94.58

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金业绩比较基准变化 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 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）

1. 业绩比较基准上 升 5%	2, 835, 278. 59	3, 916, 007. 15
2. 业绩比较基准下 降 5%	-2, 835, 278. 59	-3, 916, 007. 15

注：本基金采用历史数据拟合回归方法来进行其他价格风险敏感性分析。

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 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	54, 814, 477. 54	112, 394, 068. 80
第二层次	-	619, 484. 00
第三层次	76, 493. 97	70, 693. 38
合计	54, 890, 971. 51	113, 084, 246. 18

6. 4. 14. 2. 2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、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将相关股票和可转换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，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

6. 4. 14. 3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

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货币资金、应收款项和其他金融负债，其公允价值与账面价值相若。

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	54,890,971.51	89.70
	其中：股票	54,890,971.51	89.70
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	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	5,865,633.82	9.59
8	其他各项资产	437,123.36	0.71
9	合计	61,193,728.69	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	148,466.00	0.25
B	采矿业	2,234,708.00	3.77
C	制造业	30,003,305.66	50.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	674,776.00	1.14
E	建筑业	418,360.00	0.71
F	批发和零售业	296,340.00	0.50
G	交通运输、仓储和邮政业	1,075,187.00	1.81
H	住宿和餐饮业	5,782.00	0.01

I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,135,651.50	5.29
J	金融业	4,400,793.00	7.43
K	房地产业	276,840.00	0.47
L	租赁和商务服务业	411,816.00	0.69
M	科学研究和技术服务业	765,210.00	1.29
N	水利、环境和公共设施管理业	235,306.80	0.40
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	360.00	-
Q	卫生和社会工作	6,046.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	3,380.00	0.01
S	综合	3,358.00	0.01
	合计	44,095,685.96	74.40

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	36,856.00	0.06
B	采矿业	793,316.00	1.34
C	制造业	7,120,214.29	12.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	257,162.00	0.43
E	建筑业	246,424.00	0.42
F	批发和零售业	83,669.00	0.14
G	交通运输、仓储和邮政业	291,203.12	0.49
H	住宿和餐饮业	56,800.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,066,456.74	1.80
J	金融业	667,176.00	1.13
K	房地产业	3,796.00	0.01
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	87,832.40	0.15
N	水利、环境和公共设施管理业	82,460.00	0.14
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	1,920.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	10,795,285.55	18.21

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

报告期末本基金未持有港股通股票。

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	2,200	2,794,000.00	4.71
2	300750	宁德时代	5,650	2,220,506.50	3.75
3	300502	新易盛	2,940	1,784,580.00	3.01
4	688256	寒武纪	1,090	1,739,149.50	2.93
5	601899	紫金矿业	44,300	1,113,702.00	1.88
6	688041	海光信息	3,000	1,110,900.00	1.87
7	600519	贵州茅台	900	1,066,941.00	1.80
8	002371	北方华创	1,200	1,061,472.00	1.79
9	601318	中国平安	21,100	1,007,314.00	1.70
10	000333	美的集团	12,500	944,125.00	1.59
11	601288	农业银行	128,900	782,423.00	1.32
12	600183	生益科技	4,500	780,300.00	1.32
13	002415	海康威视	21,900	748,980.00	1.26
14	601398	工商银行	104,500	738,815.00	1.25
15	603986	兆易创新	900	733,500.00	1.24
16	002475	立讯精密	10,300	725,120.00	1.22
17	600584	长电科技	6,400	662,720.00	1.12
18	600111	北方稀土	13,600	653,480.00	1.10
19	601628	中国人寿	17,400	615,090.00	1.04
20	600036	招商银行	16,800	596,400.00	1.01
21	000338	潍柴动力	20,700	564,075.00	0.95
22	002594	比亚迪	6,900	549,930.00	0.93
23	688981	中芯国际	3,300	524,106.00	0.88
24	600760	中航沈飞	12,300	505,530.00	0.85
25	688498	源杰科技	267	503,562.00	0.85
26	300476	胜宏科技	1,400	485,002.00	0.82
27	601728	中国电信	91,400	474,366.00	0.80
28	603259	药明康德	3,800	473,138.00	0.80

29	600900	长江电力	17,400	460,578.00	0.78
30	300433	蓝思科技	8,200	440,012.00	0.74
31	601857	中国石油	48,500	420,980.00	0.71
32	000725	京东方 A	48,400	420,112.00	0.71
33	000938	紫光股份	14,200	409,812.00	0.69
34	603993	洛阳钼业	23,100	405,405.00	0.68
35	300394	天孚通信	1,320	399,537.60	0.67
36	605117	德业股份	3,640	386,495.20	0.65
37	601668	中国建筑	84,800	368,032.00	0.62
38	002008	大族激光	2,400	360,264.00	0.61
39	600176	中国巨石	4,900	357,112.00	0.60
40	688235	百济神州	1,400	356,454.00	0.60
41	002821	凯莱英	2,200	356,400.00	0.60
42	600150	中国船舶	10,500	354,795.00	0.60
43	600522	中天科技	5,400	327,672.00	0.55
44	002120	韵达股份	46,900	298,284.00	0.50
45	600887	伊利股份	12,400	297,104.00	0.50
46	300759	康龙化成	10,000	289,300.00	0.49
47	300274	阳光电源	1,800	286,236.00	0.48
48	002273	水晶光电	7,700	273,196.00	0.46
49	000001	平安银行	26,900	270,345.00	0.46
50	300475	香农芯创	900	270,000.00	0.46
51	600460	士兰微	4,900	267,834.00	0.45
52	600233	圆通速递	16,900	266,175.00	0.45
53	603659	璞泰来	9,200	266,156.00	0.45
54	002352	顺丰控股	8,500	265,710.00	0.45
55	002709	天赐材料	5,100	262,293.00	0.44
56	300677	英科医疗	6,600	258,522.00	0.44
57	601600	中国铝业	31,400	258,108.00	0.44
58	002602	世纪华通	18,100	255,210.00	0.43
59	002202	金风科技	10,600	253,340.00	0.43
60	600570	恒生电子	11,900	252,161.00	0.43
61	603799	华友钴业	5,200	250,952.00	0.42
62	603019	中科曙光	2,300	246,629.00	0.42
63	601088	中国神华	6,300	245,952.00	0.41
64	300748	金力永磁	7,900	243,715.00	0.41
65	300763	锦浪科技	2,600	234,910.00	0.40
66	002603	以岭药业	15,600	234,000.00	0.39
67	002266	浙富控股	45,700	231,242.00	0.39
68	000807	云铝股份	10,100	223,614.00	0.38
69	300058	蓝色光标	15,800	217,408.00	0.37
70	600580	卧龙电驱	6,400	211,840.00	0.36
71	600875	东方电气	7,300	210,021.00	0.35

72	002384	东山精密	800	209,880.00	0.35
73	600066	宇通客车	7,800	209,118.00	0.35
74	600674	川投能源	14,300	202,631.00	0.34
75	603288	海天味业	5,987	198,528.92	0.33
76	000157	中联重科	27,900	194,463.00	0.33
77	600499	科达制造	13,400	184,920.00	0.31
78	002625	光启技术	5,800	175,856.00	0.30
79	600048	保利发展	37,000	171,310.00	0.29
80	000408	藏格矿业	2,300	159,436.00	0.27
81	601319	中国人保	23,200	156,832.00	0.26
82	600019	宝钢股份	27,300	148,239.00	0.25
83	002714	牧原股份	4,200	146,958.00	0.25
84	600741	华域汽车	9,100	141,232.00	0.24
85	600276	恒瑞医药	2,700	140,508.00	0.24
86	300054	鼎龙股份	1,200	127,164.00	0.21
87	601816	京沪高铁	27,800	125,934.00	0.21
88	688188	柏楚电子	1,120	119,504.00	0.20
89	601988	中国银行	20,000	114,400.00	0.19
90	600406	国电南瑞	4,900	111,965.00	0.19
91	600893	航发动力	2,700	103,518.00	0.17
92	600208	衢州发展	34,600	97,918.00	0.17
93	601888	中国中免	1,800	96,678.00	0.16
94	002027	分众传媒	19,500	94,380.00	0.16
95	000651	格力电器	2,500	93,750.00	0.16
96	601919	中远海控	7,000	92,820.00	0.16
97	600521	华海药业	5,700	82,080.00	0.14
98	300442	润泽科技	900	74,763.00	0.13
99	600031	三一重工	4,200	72,576.00	0.12
100	000617	中油资本	10,900	71,831.00	0.12
101	600104	上汽集团	7,300	71,248.00	0.12
102	301308	江波龙	100	70,380.00	0.12
103	600309	万华化学	1,000	68,410.00	0.12
104	002078	太阳纸业	4,400	54,956.00	0.09
105	688012	中微公司	98	45,913.00	0.08
106	688111	金山办公	200	42,610.00	0.07
107	600547	山东黄金	1,600	36,944.00	0.06
108	600487	亨通光电	300	32,802.00	0.06
109	002466	天齐锂业	500	30,660.00	0.05
110	601117	中国化学	3,700	27,195.00	0.05
111	601677	明泰铝业	1,500	24,900.00	0.04
112	600535	天士力	1,800	23,814.00	0.04
113	600089	特变电工	1,000	22,500.00	0.04
114	600050	中国联通	5,200	20,800.00	0.04

115	002407	多氟多	400	20,092.00	0.03
116	300033	同花顺	80	19,280.00	0.03
117	601127	赛力斯	300	18,375.00	0.03
118	600398	海澜之家	3,300	17,259.00	0.03
119	688002	睿创微纳	100	15,469.00	0.03
120	300760	迈瑞医疗	100	13,583.00	0.02
121	002050	三花智控	300	13,149.00	0.02
122	688777	中控技术	100	11,750.00	0.02
123	002938	鹏鼎控股	100	10,538.00	0.02
124	603501	豪威集团	100	9,485.00	0.02
125	600549	厦门钨业	100	8,520.00	0.01
126	601166	兴业银行	500	8,280.00	0.01
127	000858	五粮液	100	7,400.00	0.01
128	000063	中兴通讯	200	7,238.00	0.01
129	002837	英维克	90	7,160.40	0.01
130	601872	招商轮船	400	7,028.00	0.01
131	000977	浪潮信息	100	7,000.00	0.01
132	300124	汇川技术	100	6,633.00	0.01
133	601766	中国中车	1,200	6,240.00	0.01
134	300316	晶盛机电	100	6,040.00	0.01
135	000792	盐湖股份	200	6,038.00	0.01
136	600667	太极实业	200	5,836.00	0.01
137	600655	豫园股份	1,400	5,754.00	0.01
138	002558	巨人网络	200	5,512.00	0.01
139	600160	巨化股份	100	5,301.00	0.01
140	601012	隆基绿能	400	5,248.00	0.01
141	601868	中国能建	1,900	5,073.00	0.01
142	600660	福耀玻璃	100	5,044.00	0.01
143	300073	当升科技	100	4,804.00	0.01
144	000538	云南白药	100	4,737.00	0.01
145	002185	华天科技	200	4,462.00	0.01
146	301236	软通动力	100	4,245.00	0.01
147	000519	中兵红箭	200	4,214.00	0.01
148	002595	豪迈科技	90	4,194.00	0.01
149	000768	中航西飞	200	4,096.00	0.01
150	300450	先导智能	100	4,072.00	0.01
151	601225	陕西煤业	200	4,070.00	0.01
152	000425	徐工机械	500	4,045.00	0.01
153	300418	昆仑万维	100	4,036.00	0.01
154	600332	白云山	200	4,008.00	0.01
155	601658	邮储银行	800	3,944.00	0.01
156	300024	机器人	200	3,866.00	0.01
157	000547	航天发展	200	3,830.00	0.01

158	000066	中国长城	200	3,810.00	0.01
159	002555	三七互娱	200	3,774.00	0.01
160	000738	航发控制	200	3,658.00	0.01
161	002544	普天科技	200	3,644.00	0.01
162	600862	中航高科	200	3,606.00	0.01
163	600754	锦江酒店	200	3,598.00	0.01
164	603939	益丰药房	200	3,596.00	0.01
165	600026	中远海能	200	3,588.00	0.01
166	000625	长安汽车	500	3,585.00	0.01
167	000887	中鼎股份	200	3,578.00	0.01
168	600028	中国石化	800	3,568.00	0.01
169	002389	航天彩虹	200	3,554.00	0.01
170	000623	吉林敖东	200	3,546.00	0.01
171	600346	恒力石化	200	3,542.00	0.01
172	600312	平高电气	200	3,532.00	0.01
173	002600	领益智造	200	3,468.00	0.01
174	600000	浦发银行	400	3,444.00	0.01
175	600763	通策医疗	100	3,388.00	0.01
176	600673	东阳光	100	3,358.00	0.01
177	603806	福斯特	200	3,358.00	0.01
178	000034	神州数码	120	3,330.00	0.01
179	002236	大华股份	200	3,298.00	0.01
180	002601	龙佰集团	200	3,296.00	0.01
181	000878	云南铜业	200	3,176.00	0.01
182	600803	新奥股份	200	3,160.00	0.01
183	600143	金发科技	200	3,090.00	0.01
184	601607	上海医药	200	3,080.00	0.01
185	601567	三星电气	200	2,988.00	0.01
186	601179	中国西电	200	2,984.00	0.01
187	600392	盛和资源	100	2,977.00	0.01
188	601390	中国中铁	700	2,919.00	0.00
189	600030	中信证券	100	2,873.00	0.00
190	601601	中国太保	100	2,852.00	0.00
191	002001	新和成	100	2,842.00	0.00
192	000963	华东医药	100	2,812.00	0.00
193	600316	洪都航空	100	2,794.00	0.00
194	300012	华测检测	200	2,772.00	0.00
195	300083	创世纪	200	2,724.00	0.00
196	600886	国投电力	200	2,662.00	0.00
197	002414	高德红外	200	2,652.00	0.00
198	600511	国药股份	100	2,604.00	0.00
199	300142	沃森生物	200	2,598.00	0.00
200	600765	中航重机	200	2,584.00	0.00

201	001979	招商蛇口	400	2,572.00	0.00
202	002223	鱼跃医疗	100	2,566.00	0.00
203	002465	海格通信	200	2,554.00	0.00
204	600038	中直股份	100	2,529.00	0.00
205	601877	正泰电器	100	2,507.00	0.00
206	000032	深桑达 A	100	2,495.00	0.00
207	603568	伟明环保	160	2,460.80	0.00
208	002007	华兰生物	200	2,438.00	0.00
209	600352	浙江龙盛	200	2,422.00	0.00
210	600438	通威股份	200	2,422.00	0.00
211	600497	驰宏锌锗	200	2,422.00	0.00
212	002129	TCL 中环	200	2,404.00	0.00
213	000830	鲁西化工	200	2,400.00	0.00
214	600426	华鲁恒升	100	2,392.00	0.00
215	002318	久立特材	100	2,390.00	0.00
216	002155	湖南黄金	100	2,387.00	0.00
217	603596	伯特利	96	2,384.64	0.00
218	002271	东方雨虹	200	2,374.00	0.00
219	300003	乐普医疗	200	2,370.00	0.00
220	002648	卫星化学	100	2,349.00	0.00
221	300122	智飞生物	200	2,338.00	0.00
222	600161	天坛生物	200	2,316.00	0.00
223	601615	明阳智能	200	2,314.00	0.00
224	600085	同仁堂	100	2,311.00	0.00
225	600009	上海机场	100	2,310.00	0.00
226	601058	赛轮轮胎	200	2,306.00	0.00
227	000301	东方盛虹	200	2,290.00	0.00
228	002241	歌尔股份	100	2,253.00	0.00
229	000999	华润三九	100	2,249.00	0.00
230	600196	复星医药	100	2,247.00	0.00
231	603816	顾家家居	100	2,236.00	0.00
232	002085	万丰奥威	200	2,218.00	0.00
233	300251	光线传媒	200	2,218.00	0.00
234	600258	首旅酒店	200	2,184.00	0.00
235	000400	许继电气	100	2,170.00	0.00
236	600372	中航机载	200	2,170.00	0.00
237	601233	桐昆股份	100	2,165.00	0.00
238	600699	均胜电子	100	2,161.00	0.00
239	002493	荣盛石化	200	2,150.00	0.00
240	002532	天山铝业	200	2,146.00	0.00
241	600879	航天电子	100	2,129.00	0.00
242	000933	神火股份	100	2,120.00	0.00
243	601727	上海电气	300	2,100.00	0.00

244	603899	晨光股份	100	2,063.00	0.00
245	603885	吉祥航空	200	2,058.00	0.00
246	601155	新城控股	200	2,052.00	0.00
247	600690	海尔智家	100	2,041.00	0.00
248	300059	东方财富	100	2,038.00	0.00
249	002497	雅化集团	100	2,037.00	0.00
250	600989	宝丰能源	100	2,033.00	0.00
251	688009	中国通号	400	1,904.00	0.00
252	688223	晶科能源	400	1,900.00	0.00
253	300207	欣旺达	100	1,899.00	0.00
254	002064	华峰化学	200	1,898.00	0.00
255	002130	沃尔核材	100	1,896.00	0.00
256	002456	欧菲光	200	1,892.00	0.00
257	600018	上港集团	400	1,888.00	0.00
258	600588	用友网络	200	1,836.00	0.00
259	600859	王府井	200	1,836.00	0.00
260	001965	招商公路	200	1,832.00	0.00
261	601211	国泰海通	100	1,820.00	0.00
262	000786	北新建材	100	1,809.00	0.00
263	688303	大全能源	100	1,743.00	0.00
264	601360	三六零	200	1,738.00	0.00
265	000975	山金国际	100	1,700.00	0.00
266	600585	海螺水泥	100	1,695.00	0.00
267	603606	东方电缆	40	1,660.40	0.00
268	300015	爱尔眼科	200	1,652.00	0.00
269	002410	广联达	200	1,632.00	0.00
270	002517	恺英网络	100	1,625.00	0.00
271	000039	中集集团	200	1,622.00	0.00
272	002459	晶澳科技	200	1,620.00	0.00
273	600153	建发股份	200	1,586.00	0.00
274	600039	四川路桥	200	1,564.00	0.00
275	002244	滨江集团	200	1,520.00	0.00
276	600011	华能国际	200	1,518.00	0.00
277	601633	长城汽车	100	1,509.00	0.00
278	000998	隆平高科	200	1,508.00	0.00
279	002572	索菲亚	200	1,460.00	0.00
280	600004	白云机场	200	1,452.00	0.00
281	002091	江苏国泰	200	1,446.00	0.00
282	002065	东华软件	200	1,428.00	0.00
283	688599	天合光能	100	1,412.00	0.00
284	600839	四川长虹	200	1,396.00	0.00
285	002340	格林美	200	1,322.00	0.00
286	002292	奥飞娱乐	200	1,312.00	0.00

287	002195	岩山科技	200	1,308.00	0.00
288	300017	网宿科技	100	1,301.00	0.00
289	002405	四维图新	200	1,294.00	0.00
290	601328	交通银行	200	1,286.00	0.00
291	000630	铜陵有色	200	1,272.00	0.00
292	600516	方大炭素	200	1,234.00	0.00
293	601111	中国国航	200	1,210.00	0.00
294	601186	中国铁建	200	1,190.00	0.00
295	000100	TCL 科技	200	1,164.00	0.00
296	300144	宋城演艺	200	1,162.00	0.00
297	000683	博源化工	200	1,152.00	0.00
298	601800	中国交建	200	1,142.00	0.00
299	600820	隧道股份	200	1,042.00	0.00
300	600864	哈投股份	200	1,038.00	0.00
301	600029	南方航空	200	1,036.00	0.00
302	601238	广汽集团	200	1,016.00	0.00
303	002044	美年健康	200	1,006.00	0.00
304	000035	中国天楹	200	966.00	0.00
305	002131	利欧股份	200	950.00	0.00
306	600704	物产中大	200	944.00	0.00
307	601669	中国电建	200	940.00	0.00
308	600998	九州通	200	938.00	0.00
309	600795	国电电力	200	934.00	0.00
310	601006	大秦铁路	200	922.00	0.00
311	601985	中国核电	100	903.00	0.00
312	601216	君正集团	200	892.00	0.00
313	002252	上海莱士	200	868.00	0.00
314	601000	唐山港	200	830.00	0.00
315	000415	渤海租赁	200	814.00	0.00
316	600219	南山铝业	200	798.00	0.00
317	003816	中国广核	200	782.00	0.00
318	600115	中国东航	200	762.00	0.00
319	600905	三峡能源	200	742.00	0.00
320	000932	华菱钢铁	200	694.00	0.00
321	300070	碧水源	200	638.00	0.00
322	601018	宁波港	200	630.00	0.00
323	000002	万科 A	200	592.00	0.00
324	600166	福田汽车	200	582.00	0.00
325	600515	海南机场	200	548.00	0.00
326	600008	首创环保	200	544.00	0.00
327	600816	建元信托	200	488.00	0.00
328	601618	中国中冶	200	488.00	0.00
329	600170	上海建工	200	444.00	0.00

330	601866	中远海发	200	442.00	0.00
331	002607	中公教育	200	360.00	0.00
332	000069	华侨城 A	200	328.00	0.00
333	600157	永泰能源	200	322.00	0.00
334	601880	辽港股份	200	276.00	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	301031	中熔电气	3,568	426,197.60	0.72
2	688110	东芯股份	1,400	285,180.00	0.48
3	301349	信德新材	3,780	278,208.00	0.47
4	688728	格科微	13,200	277,728.00	0.47
5	688045	必易微	3,323	268,431.94	0.45
6	605020	永和股份	6,300	256,536.00	0.43
7	688301	奕瑞科技	2,021	250,604.00	0.42
8	603929	亚翔集成	900	244,818.00	0.41
9	301511	德福科技	1,600	230,160.00	0.39
10	601878	浙商证券	23,200	220,400.00	0.37
11	688778	厦钨新能	4,019	218,633.60	0.37
12	601138	工业富联	3,000	216,450.00	0.37
13	600995	南网储能	17,500	215,250.00	0.36
14	603093	南华期货	11,800	214,170.00	0.36
15	600256	广汇能源	43,200	213,408.00	0.36
16	002142	宁波银行	7,000	207,830.00	0.35
17	002192	融捷股份	2,300	205,620.00	0.35
18	002695	煌上煌	19,800	200,970.00	0.34
19	688059	华锐精密	1,000	199,710.00	0.34
20	300738	奥飞数据	9,800	198,156.00	0.33
21	001205	盛航股份	14,400	196,992.00	0.33
22	300483	首华燃气	11,150	196,017.00	0.33
23	688095	福昕软件	3,200	190,176.00	0.32
24	002534	西子洁能	10,200	189,210.00	0.32
25	603195	公牛集团	4,800	187,920.00	0.32
26	600320	振华重工	44,300	182,959.00	0.31
27	002111	威海广泰	20,200	181,800.00	0.31
28	300957	贝泰妮	5,700	179,607.00	0.30
29	603629	利通电子	1,000	178,810.00	0.30
30	301526	国际复材	3,800	177,346.00	0.30
31	301261	恒工精密	2,200	171,820.00	0.29
32	600546	山煤国际	14,700	160,671.00	0.27
33	002768	国恩股份	2,760	143,685.60	0.24
34	688410	山外山	9,800	140,728.00	0.24

35	603379	三美股份	1,500	113,835.00	0.19
36	002990	盛视科技	1,400	110,600.00	0.19
37	688332	中科蓝讯	688	108,360.00	0.18
38	000422	湖北宜化	7,400	103,970.00	0.18
39	002317	众生药业	4,200	103,194.00	0.17
40	002393	力生制药	6,980	99,046.20	0.17
41	688319	欧林生物	2,200	96,756.00	0.16
42	688291	金橙子	1,600	93,568.00	0.16
43	688141	杰华特	600	92,100.00	0.16
44	002518	科士达	1,700	91,103.00	0.15
45	002046	国机精工	1,200	88,380.00	0.15
46	300693	盛弘股份	1,800	87,750.00	0.15
47	300397	天和防务	5,600	84,784.00	0.14
48	688379	华光新材	1,000	84,030.00	0.14
49	002979	雷赛智能	1,500	83,670.00	0.14
50	301319	唯特偶	500	83,665.00	0.14
51	603931	格林达	1,400	83,160.00	0.14
52	000709	河钢股份	42,000	81,480.00	0.14
53	301389	隆扬电子	900	78,111.00	0.13
54	688010	福光股份	1,600	77,808.00	0.13
55	600960	渤海汽车	19,200	77,376.00	0.13
56	600513	联环药业	5,200	75,608.00	0.13
57	003027	同兴科技	4,200	73,206.00	0.12
58	300797	钢研纳克	5,400	71,604.00	0.12
59	002250	联化科技	5,200	71,084.00	0.12
60	603711	香飘飘	6,200	68,882.00	0.12
61	002338	奥普光电	1,100	62,920.00	0.11
62	601083	锦江航运	6,100	60,634.00	0.10
63	605108	同庆楼	5,000	56,800.00	0.10
64	301110	青木科技	1,280	48,460.80	0.08
65	688790	昂瑞微	377	47,671.65	0.08
66	603900	莱绅通灵	7,100	39,973.00	0.07
67	600598	北大荒	3,400	36,856.00	0.06
68	688148	芳源股份	4,200	36,036.00	0.06
69	603444	吉比特	100	35,842.00	0.06
70	002653	海思科	500	33,170.00	0.06
71	301369	联动科技	135	33,075.00	0.06
72	603906	龙蟠科技	1,100	29,183.00	0.05
73	000612	焦作万方	2,700	28,593.00	0.05
74	002468	申通快递	1,800	26,208.00	0.04
75	688809	强一股份	38	23,674.00	0.04
76	001298	好上好	1,100	22,825.00	0.04
77	000729	燕京啤酒	2,200	22,286.00	0.04

78	002117	东港股份	2,800	22,064.00	0.04
79	688807	优迅股份	53	21,328.79	0.04
80	000987	越秀资本	2,700	21,114.00	0.04
81	000570	苏常柴 A	4,500	21,015.00	0.04
82	002039	黔源电力	1,100	20,702.00	0.03
83	600685	中船防务	800	20,352.00	0.03
84	603558	健盛集团	1,800	19,962.00	0.03
85	605099	共创草坪	600	19,320.00	0.03
86	000722	湖南发展	1,700	19,312.00	0.03
87	603893	瑞芯微	100	18,836.00	0.03
88	688557	兰剑智能	600	18,618.00	0.03
89	301662	宏工科技	180	18,237.60	0.03
90	603101	汇嘉时代	2,900	18,096.00	0.03
91	601069	西部黄金	800	17,600.00	0.03
92	301108	洁雅股份	700	16,513.00	0.03
93	600727	鲁北化工	2,400	16,128.00	0.03
94	688700	东威科技	175	15,645.00	0.03
95	688712	北芯生命	392	14,080.64	0.02
96	688796	百奥赛图	116	12,690.40	0.02
97	688785	恒运昌	26	12,041.90	0.02
98	002297	博云新材	400	11,596.00	0.02
99	300953	震裕科技	80	10,696.00	0.02
100	601698	中国卫通	300	9,075.00	0.02
101	002033	丽江股份	1,000	8,260.00	0.01
102	688805	健信超导	149	6,998.53	0.01
103	603296	华勤技术	80	5,941.60	0.01
104	002612	朗姿股份	500	5,605.00	0.01
105	603699	纽威股份	100	5,030.00	0.01
106	301517	陕西华达	100	4,963.00	0.01
107	301252	同星科技	100	4,053.00	0.01
108	301283	聚胶股份	165	4,039.20	0.01
109	600007	中国国贸	200	3,796.00	0.01
110	002747	埃斯顿	100	3,733.00	0.01
111	300633	开立医疗	200	3,678.00	0.01
112	600845	宝信软件	200	3,326.00	0.01
113	000920	沃顿科技	200	3,292.00	0.01
114	002180	奔图科技	200	3,272.00	0.01
115	601089	福元医药	200	3,256.00	0.01
116	600882	妙可蓝多	200	3,198.00	0.01
117	002151	北斗星通	100	3,175.00	0.01
118	600012	皖通高速	200	3,152.00	0.01
119	600801	华新建材	200	3,120.00	0.01
120	300980	祥源新材	100	2,941.00	0.00

121	300413	芒果超媒	200	2,926.00	0.00
122	000818	航锦科技	200	2,904.00	0.00
123	300590	移为通信	200	2,870.00	0.00
124	688244	永信至诚	200	2,852.00	0.00
125	300627	华测导航	100	2,840.00	0.00
126	603162	海通发展	296	2,655.12	0.00
127	000708	中信特钢	200	2,524.00	0.00
128	600976	健民集团	100	2,491.00	0.00
129	300383	光环新网	200	2,488.00	0.00
130	002624	完美世界	200	2,484.00	0.00
131	603860	中公高科	100	2,419.00	0.00
132	601112	振石股份	132	2,346.20	0.00
133	300088	长信科技	200	2,320.00	0.00
134	600750	华润江中	100	2,207.00	0.00
135	601966	玲珑轮胎	200	2,038.00	0.00
136	601963	重庆银行	200	2,016.00	0.00
137	002739	儒意电影	200	1,920.00	0.00
138	002911	佛燃能源	200	1,898.00	0.00
139	002312	川发龙蟒	200	1,834.00	0.00
140	688633	星球石墨	61	1,813.53	0.00
141	605338	巴比食品	100	1,790.00	0.00
142	000581	威孚高科	100	1,702.00	0.00
143	001338	永顺泰	200	1,678.00	0.00
144	600637	东方明珠	200	1,662.00	0.00
145	002423	中粮资本	200	1,646.00	0.00
146	002392	北京利尔	200	1,614.00	0.00
147	600867	通化东宝	200	1,608.00	0.00
148	601886	江河集团	200	1,606.00	0.00
149	300002	神州泰岳	200	1,562.00	0.00
150	600428	中远海特	200	1,562.00	0.00
151	603969	银龙股份	200	1,454.00	0.00
152	603180	金牌家居	100	1,372.00	0.00
153	300253	卫宁健康	200	1,346.00	0.00
154	000801	四川九洲	100	1,294.00	0.00
155	001322	箭牌家居	200	1,208.00	0.00
156	605189	富春染织	100	1,205.00	0.00
157	301552	科力装备	52	1,161.16	0.00
158	002811	郑中设计	100	1,119.00	0.00
159	603352	至信股份	41	1,046.32	0.00
160	300140	节能环保	200	994.00	0.00
161	002145	钛能化学	200	942.00	0.00
162	002153	石基信息	100	723.00	0.00
163	300459	汤姆猫	200	678.00	0.00

164	000629	钒钛股份	200	668.00	0.00
165	600496	精工钢构	200	620.00	0.00
166	000922	佳电股份	40	558.40	0.00
167	603077	和邦生物	200	464.00	0.00
168	603248	锡华科技	18	379.62	0.00
169	601933	永辉超市	100	284.00	0.00
170	600802	福建水泥	20	82.40	0.00
171	300926	博俊科技	1	17.75	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	300502	新易盛	1,830,695.00	1.53
2	688256	寒武纪	1,644,495.50	1.38
3	300433	蓝思科技	1,529,986.00	1.28
4	300308	中际旭创	1,456,503.00	1.22
5	600111	北方稀土	1,377,770.00	1.15
6	601138	工业富联	1,235,977.00	1.03
7	688041	海光信息	1,201,614.01	1.01
8	600276	恒瑞医药	1,165,547.40	0.97
9	601600	中国铝业	1,144,849.00	0.96
10	000333	美的集团	1,114,639.00	0.93
11	601318	中国平安	1,080,104.00	0.90
12	002475	立讯精密	1,070,378.00	0.90
13	600089	特变电工	1,065,788.00	0.89
14	002709	天赐材料	1,053,565.00	0.88
15	300476	胜宏科技	1,052,263.00	0.88
16	002594	比亚迪	1,040,573.00	0.87
17	603259	药明康德	1,030,092.00	0.86
18	300394	天孚通信	1,029,618.00	0.86
19	688981	中芯国际	998,624.63	0.84
20	002371	北方华创	993,042.00	0.83

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	3,871,281.50	3.24
2	300750	宁德时代	3,785,662.97	3.17
3	300308	中际旭创	3,351,096.00	2.80

4	601318	中国平安	3,323,265.00	2.78
5	600036	招商银行	2,784,506.00	2.33
6	601899	紫金矿业	2,563,780.00	2.14
7	600276	恒瑞医药	2,087,398.00	1.75
8	300502	新易盛	2,076,876.00	1.74
9	002475	立讯精密	2,074,585.00	1.74
10	601288	农业银行	2,029,155.00	1.70
11	000333	美的集团	2,009,591.00	1.68
12	600150	中国船舶	1,947,687.00	1.63
13	601398	工商银行	1,919,497.00	1.61
14	688041	海光信息	1,918,409.45	1.60
15	603993	洛阳钼业	1,866,155.00	1.56
16	002371	北方华创	1,800,137.00	1.51
17	688256	寒武纪	1,792,248.00	1.50
18	600900	长江电力	1,768,786.00	1.48
19	002415	海康威视	1,676,633.00	1.40
20	000063	中兴通讯	1,653,701.00	1.38

注：本项“卖出金额”均按卖出成交金额（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

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	165,551,097.11
卖出股票收入（成交）总额	231,922,034.00

注：本项“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

报告期末本基金未持有债券。

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

报告期末本基金未持有债券。

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

报告期末本基金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

报告期末本基金未投资贵金属。

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

报告期末本基金未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在股指期货投资中将以控制风险为原则，以套期保值为目的，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，并按照中国金融期货交易所套期保值管理的有关规定执行。

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

截至报告期末本基金未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

截至报告期末本基金未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

本基金本报告期投资的前十名证券中发行主体未发生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、处罚的情况。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同约定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	368,680.80
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	68,442.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	437,123.36

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末本基金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

报告期末本基金指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

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

报告期末本基金积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告涉及合计数相关比例的，均以合计数除以相关数据计算，而不是对不同比例进行合计。

§ 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（%）
泰信中证 A500 指数增强 A	186	161,670.59	9,500,477.77	31.59	20,570,252.12	68.41
泰信中证 A500 指数增强 C	491	46,169.86	0.00	0.00	22,669,402.68	100.00
合计	677	77,902.71	9,500,477.77	18.01	43,239,654.80	81.99

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金份额。

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	泰信中证 A500 指数增强 A	0
	泰信中证 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	泰信中证 A500 指数增强 A	0
	泰信中证 A500 指数增强 C	0
	合计	0

注：基金份额总量的数量区间为 0、0 至 10 万份（含）、10 万份至 50 万份（含）、50 万份至 100

万份（含）、100 万份以上。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	泰信中证 A500 指数增强 A	泰信中证 A500 指数增强 C
基金合同生效日 （2025 年 9 月 23 日） 基金份额总额	95,354,377.64	137,107,970.74
本报告期期初基金份 额总额	61,619,468.26	55,976,400.24
本报告期基金总申购 份额	6,494,340.69	13,250,435.74
减：本报告期基金总 赎回份额	38,043,079.06	46,557,433.30
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	30,070,729.89	22,669,402.68

注：总申购份额含红利再投资、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

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

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、自 2026 年 2 月 10 日起，张芸红不再担任首席财务官。具体详情参见 2026 年 2 月 10 日刊登在中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及公司网站（www.ftfund.com）上的《泰信基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。

2、自 2026 年 3 月 10 日起，段晓旭担任首席财务官。具体详情参见 2026 年 3 月 10 日刊登在中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及公司网站（www.ftfund.com）上的《泰信基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。

3、自 2026 年 6 月 22 日起，刘玉成担任首席信息官，总经理张秉麟不再代任首席信息官职务。具体详情参见 2026 年 6 月 22 日刊登在中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及公司网站（www.ftfund.com）上的《泰信基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。

上述人事变动已按相关规定进行备案。

报告期内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，无涉基金管理人、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

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人相关从业人员在开展基金托管业务过程中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 (%)	
联储证券	3	208,359,514.94	52.43	40,832.51	52.59	—
德邦证券	2	136,654,658.09	34.39	26,780.89	34.49	—
东兴证券	2	52,393,302.76	13.18	10,034.55	12.92	—

注：本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金的比例限制。

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	
	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(%)
联储证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-

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	泰信中证 A500 指数增强型证券投资基金 2025 年第四季度报告	规定报刊及规定网站	2026 年 1 月 21 日
2	泰信基金管理有限公司高级管理人员变更公告	规定报刊及规定网站	2026 年 2 月 10 日
3	泰信基金管理有限公司高级管理人员变更公告	规定报刊及规定网站	2026 年 3 月 10 日
4	泰信基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国邮政储蓄银行股份有限公司“邮你同赢”同业平台为销售机构并开通转换业务的公告	规定报刊及规定网站	2026 年 3 月 17 日
5	泰信中证 A500 指数增强型证券投资基金 2025 年年度报告	规定报刊及规定网站	2026 年 3 月 30 日
6	泰信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）	规定报刊及规定网站	2026 年 3 月 30 日
7	泰信中证 A500 指数增强型证券投资基金 2026 年第一季度报告	规定报刊及规定网站	2026 年 4 月 21 日
8	泰信基金管理有限公司高级管理人员变更公告	规定报刊及规定网站	2026 年 6 月 22 日

§ 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

报告期内未出现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

无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准泰信中证 A500 指数增强型证券投资基金设立的文件
- 2、《泰信中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》
- 3、《泰信中证 A500 指数增强型证券投资基金招募说明书》
- 4、《泰信中证 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、营业执照和公司章程
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照

12.2 存放地点

本报告分别置备于基金管理人、基金托管人的住所，供投资者免费查阅。

12.3 查阅方式

投资者可直接登录本基金管理人公司网站(www.ftfund.com)查阅上述相关文件，或拨打客户服务中心电话(400-888-5988，021-38784566)，和本基金管理人直接联系。

泰信基金管理有限公司

2026 年 8 月 28 日