

财通沪深 300 指数增强型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:财通基金管理有限公司

基金托管人:中国光大银行股份有限公司

送出日期:2026 年 08 月 29 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年08月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年01月01日起至2026年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
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	60
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	60
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	61

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	61
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	61
7.12 投资组合报告附注.....	61
§8 基金份额持有人信息.....	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	63
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	63
§9 开放式基金份额变动.....	63
§10 重大事件揭示.....	63
10.1 基金份额持有人大会决议.....	63
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	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	63
10.4 基金投资策略的改变.....	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	64
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	64
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	64
10.8 其他重大事件.....	65
§11 影响投资者决策的其他重要信息	66
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.....	66
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	66
§12 备查文件目录.....	67
12.1 备查文件目录.....	67
12.2 存放地点.....	67
12.3 查阅方式.....	67

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	财通沪深300指数增强型证券投资基金
基金简称	财通沪深300指数增强
场内简称	-
基金主代码	005850
交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年12月21日
基金管理人	财通基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	54,824,592.16份
基金合同存续期	不定期

注：自2022年12月21日起，“财通量化价值优选灵活配置混合型证券投资基金”的基金名称变更为“财通沪深300指数增强型证券投资基金”，并正式实施基金转型。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，进行积极的组合管理和风险控制，力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金的主要投资策略包括：股票投资策略、存托凭证投资策略、固定收益类资产投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货的投资策略、股票期权投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金是股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，跟踪沪深300指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

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		财通基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	方斌	王茵
	联系电话	021-20537888	010-63639180
	电子邮箱	service@ctfund.com	wangyin@cebbank.com
客户服务电话		400-820-9888	95595
传真		021-68888169/021-68888661	010-63639132
注册地址		上海市虹口区吴淞路619号505室	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
办公地址		上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心43、45楼	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码		200120	100033
法定代表人		吴林惠	吴利军

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.ctfund.com
基金中期报告置备地点	基金管理人和基金托管人办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	财通基金管理有限公司	上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心43、45楼

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2026年01月01日- 2026年06月30日)
本期已实现收益	20,535,856.90
本期利润	15,256,731.47
加权平均基金份额本期利润	0.1649
本期加权平均净值利润率	9.80%
本期基金份额净值增长率	9.94%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2026年06月30日)
期末可供分配利润	42,872,844.91
期末可供分配基金份额利润	0.7820
期末基金资产净值	98,980,064.01
期末基金份额净值	1.8054
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2026年06月30日)
基金份额累计净值增长率	32.31%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	12.87%	1.19%	11.30%	1.19%	1.57%	0.00%
过去六个月	9.94%	1.07%	7.20%	1.07%	2.74%	0.00%

过去一年	27.46%	0.95%	25.13%	0.97%	2.33%	-0.02%
过去三年	31.18%	1.05%	28.26%	1.06%	2.92%	-0.01%
自基金合同生效起至今	32.31%	1.01%	28.73%	1.02%	3.58%	-0.01%

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



注：(1)本基金转型日为2022年12月21日；
(2)本基金建仓期为自基金合同生效起6个月内，建仓期结束时，本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

财通基金管理有限公司（下称“财通基金”）经中国证监会批准，于2011年6月正式成立。目前公司拥有公募基金管理、特定客户资产管理、QDII、受托管理保险资金投资管理等业务资格。公司股东为财通证券股份有限公司、杭州市实业投资集团有限公司和浙江亨通控股股份有限公司，注册资本2亿元人民币，注册地上海。成立15年来，公司收获了“三大报”权威奖项（金牛奖+金基金奖+明星基金奖），先后荣获167项业内权威大奖。

截至2026年6月末，财通基金合计管理规模约2,172.25亿元，其中，公募基金管理规模约1,670.83亿元。公司以打造“特色鲜明、多元发展、客户信赖”的一流资产管理公司为企业愿景，坚持多元化业务布局，旗下公募基金覆盖股票、混合、债券、指数、货币等完整产品线，可满足不同类型客户的多元化需求。同时公司在专户业务中勇于突破，不断探索定增+、固收+、量化+等特色领域，努力以专业创造价值。

财通基金始终恪守“敬畏、感恩、专业、责任”的核心价值观，坚信投研是核心竞争力，为客户创造收益才是硬道理。公司以资产管理为本源，坚守初心、苦练内功，配备了一支资深投研专家团队，纵深一级半、二级市场，持续为投资者创造价值。

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		
朱海东	量化投资部副总经理（主持工作）、本基金的基金经理	2019-07-16	-	14年	复旦大学基础数学硕士。历任银河基金管理有限公司量化研究员，平安资产管理有限责任公司研究经理。2019年6月加入财通基金管理有限公司，曾任量化投资部基金经理、总经理助理（主持工作），现任量化投资部副总经理（主持工作）、基金经理。
郭欣	本基金的基金经理	2024-03-08	-	12年	上海财经大学概率论与数理统计硕士。历任诺德基金管理有限公司研究员，上海翼丰投资管理有限公司量化研究员。2017年11月加入财通基金管理有限公司，曾任量化投资部研究员、投资经理助理、投资经理，现任量化投资部基金经理。

注：(1)首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

(2)非首任基金经理的“任职日期”和“离任日期”分别为根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

(3)证券从业的含义遵从法律法规及行业协会的相关规定。

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

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和本基金合同，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。本报告期内，未发现本基金存在可能导致利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，本基金组合采用量化模型，在控制相对基准指数跟踪误差的基础上，力争实现相对基准的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，财通沪深300指数增强基金份额净值为1.8054元，本报告期内，基金份额净值增长率为9.94%，同期业绩比较基准收益率为7.20%。

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，国内宏观经济预计仍将呈现总量温和修复与结构性分化并存的格局。就总量层面而言，经济复苏步伐总体平稳；但就结构层面而言，不同行业之间的景气度差异依然存在。外部环境方面，美国经济韧性犹存，这意味着美联储降息进程仍将受到通胀回落节奏与就业市场状况的共同约束；与此同时，地缘政治不确定性及能源价格波动，将继续对全球风险偏好构成阶段性扰动。就国内权益市场而言，下半年A股指数中枢预计将在震荡中缓慢上移，但内部分化格局难以发生根本性改变。尽管AI产业链的长期逻辑尚未演绎完毕，但市场对此已有较为充分的认知与定价，因此下半年市场风格有望趋于均衡，单一方向的过度超额收益表现或将有所收敛。市场关注焦点将进一步从主题概念转向基本面兑现，缺乏现金流与业绩支撑的高估值品种，其后续波动幅度可能显著加剧。我们认为盈利改善动能能否由上游资源品逐步向中下游制造与消费领域传导，将成为决定下半年市场能否由结构性行情迈向更全面修复的关键观察变量之一。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会、中国证券投资基金业协会和基金合同关于估值的相关规定，对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会负责根据相关估值原则研究相关估值政策和估值模型，拟定公司的估值政策、估值方法和估值程序，确定调整/暂停估值方案，确保公司各基金产品净值计算的公允性，以维护广大投资者的利益。估值委员会配备投资、研究、会计、风控等岗位资深人员，成员具有会计核算经验、行业分析经验、金融工具应用、风险管理等丰富的证券投资基金行业从业经验和专业能力。基金经理如果认为某证券有更能准确反应其公允价值的估值方法，可以向估值委员会申请对其进行专项评估。估值方法/价格调整需经估值委员会决议通过，并征询基金托管人同意后才能采纳。

基金日常估值由本基金管理人和基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金完成转型后，《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本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。

根据相关法律法规及《基金合同》的要求，结合本基金运作情况，本基金本报告期内未进行收益分配。

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

本报告期内，本基金未有连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的情形。

§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，中国光大银行股份有限公司在财通沪深300指数增强型证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面的运作严格依据基金合同的约定进行。

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

中国光大银行股份有限公司以自身能够获取的数据和信息为限，根据法律法规规定、基金合同和托管协议约定对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进行了复核，认为以上内容真实、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：财通沪深300指数增强型证券投资基金
报告截止日：2026年06月30日

单位：人民币元

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

		2026年06月30日	2025年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	9,968,590.10	24,648,343.82
结算备付金		1,511,390.20	10,425,096.98
存出保证金		1,063,152.00	1,828,886.40
交易性金融资产	6.4.7.2	86,754,353.18	297,070,445.60
其中：股票投资		86,754,353.18	297,070,445.60
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	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		291,960.10	84,785.85
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		99,589,445.58	334,057,558.65
负债和净资产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		419,767.41	592,758.09
应付管理人报酬		94,298.83	342,757.11

应付托管费		15,716.48	57,126.18
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		7,241.29	13,182.30
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	72,357.56	155,684.00
负债合计		609,381.57	1,161,507.68
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	54,824,592.16	202,730,330.69
未分配利润	6.4.7.8	44,155,471.85	130,165,720.28
净资产合计		98,980,064.01	332,896,050.97
负债和净资产总计		99,589,445.58	334,057,558.65

注：报告截止日2026年06月30日，基金份额净值1.8054元，基金份额总额54,824,592.16份。

6.2 利润表

会计主体：财通沪深300指数增强型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至202 5年06月30日
一、营业总收入		16,428,865.91	11,607,694.97
1.利息收入		18,899.43	123,752.38
其中：存款利息收入	6.4.7.9	18,899.43	123,752.38
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）		21,678,060.36	7,428,305.09
其中：股票投资收益	6.4.7.10	20,020,589.44	2,082,231.82
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		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	565,887.01	703,221.23
股利收益	6.4.7.13	1,091,583.91	4,642,852.04
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	-5,279,125.43	4,048,491.65
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	11,031.55	7,145.85
减：二、营业总支出		1,172,134.44	2,878,920.16
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	941,313.82	2,367,879.90
2.托管费	6.4.10.2.2	156,885.69	394,646.66
3.销售服务费		-	-
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	6.4.7.16	-	-
7.税金及附加		2,071.07	3,191.24
8.其他费用	6.4.7.17	71,863.86	113,202.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		15,256,731.47	8,728,774.81
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		15,256,731.47	8,728,774.81
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		15,256,731.47	8,728,774.81

6.3 净资产变动表

会计主体：财通沪深300指数增强型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	202,730,330.69	130,165,720.28	332,896,050.97
二、本期期初净资产	202,730,330.69	130,165,720.28	332,896,050.97
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-147,905,738.53	-86,010,248.43	-233,915,986.96
（一）、综合收益总额	-	15,256,731.47	15,256,731.47
（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）	-147,905,738.53	-101,266,979.90	-249,172,718.43
其中：1.基金申购款	17,438,856.93	12,174,179.97	29,613,036.90
2.基金赎回款	-165,344,595.46	-113,441,159.87	-278,785,755.33
（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	54,824,592.16	44,155,471.85	98,980,064.01
项 目	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	312,451,266.57	141,937,830.46	454,389,097.03
二、本期期初净资产	312,451,266.57	141,937,830.46	454,389,097.03
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-96,970,392.37	-36,234,470.23	-133,204,862.60
（一）、综合收益总额	-	8,728,774.81	8,728,774.81
（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）	-96,970,392.37	-44,963,245.04	-141,933,637.41
其中：1.基金申购款	83,094,835.53	37,022,201.93	120,117,037.46
2.基金赎回款	-180,065,227.90	-81,985,446.97	-262,050,674.87
（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	215,480,874.20	105,703,360.23	321,184,234.43

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：

徐春庭

刘为臻

孙金

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

财通沪深300指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”），由财通量化价值优选灵活配置混合型证券投资基金转型而成，财通量化价值优选灵活配置混合型证券投资基金系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[2018]540号文《关于准予财通量化价值优选灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，由基金管理人财通基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2019年1月30日生效，首次设立募集规模为458,980,142.88份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为财通基金管理有限公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《财通量化价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及《财通量化价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金自2022年12月21日起转型并更名为财通沪深300指数增强型证券投资基金。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以标的指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。其他包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（含国债、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、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、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、股指期货、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）。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票（含存托凭证）资产占基金资产的比例不低于80%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股占非现金基金资产的比例不低于80%。每个交易日日终在扣除股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金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》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《公开募集证券投资基金信息披露XBRL模板第3号——年度报告和中期报告》《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

本基金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以及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06月30日的财务状况、自2026年01月01日起至2026年06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

本基金本报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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[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》、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]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《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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继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》、财税[2021]33号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2024]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》、财政部、国家税务总局公告2025年第4号

《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令826号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告2026年第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)资管产品运营过程中发生的资管产品运营业务，以资管产品管理人为增值税纳税人。2027年12月31日前，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，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

(2)2027年12月31日前，对证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税。自2025年8月8日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税；对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在2025年8月8日之后续发行的部分)的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。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。

(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06月30日
活期存款	3,474,430.79

等于：本金	3,474,248.10
加：应计利息	182.69
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	6,494,159.31
等于：本金	6,494,067.01
加：应计利息	92.30
减：坏账准备	-
合计	9,968,590.10

注：其他存款期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		81,337,073.31	-	86,754,353.18	5,417,279.87
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	81,337,073.31	-	86,754,353.18	5,417,279.87
----	---------------	---	---------------	--------------

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06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	8,721,720.00	-	-	-
--股指期货	8,721,720.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	8,721,720.00	-	-	-

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
IF2607	IF2607	6.00	8,859,600.00	137,880.00
合计				137,880.00
减：可抵销 期货暂收 款				137,880.00
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

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

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

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	71,701.86
其他应付	655.70
合计	72,357.56

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	202,730,330.69	202,730,330.69
本期申购	17,438,856.93	17,438,856.93
本期赎回（以“-”号填列）	-165,344,595.46	-165,344,595.46
本期末	54,824,592.16	54,824,592.16

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

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	115,248,397.03	14,917,323.25	130,165,720.28
本期期初	115,248,397.03	14,917,323.25	130,165,720.28
本期利润	20,535,856.90	-5,279,125.43	15,256,731.47
本期基金份额交易产生的变动数	-92,911,409.02	-8,355,570.88	-101,266,979.90
其中：基金申购款	12,238,558.81	-64,378.84	12,174,179.97
基金赎回款	-105,149,967.83	-8,291,192.04	-113,441,159.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	42,872,844.91	1,282,626.94	44,155,471.85

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
活期存款利息收入	3,541.35
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	2,287.57
结算备付金利息收入	13,070.51
其他	-
合计	18,899.43

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 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01月01日至2026年06月30日
卖出股票成交总额	635,193,117.40
减：卖出股票成本总额	614,590,219.45
减：交易费用	582,308.51
买卖股票差价收入	20,020,589.44

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

本基金本报告期未有债券投资收益项目。

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期未有买卖债券差价收入。

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期未有债券赎回差价收入。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期未有债券申购差价收入。

6.4.7.12 衍生工具收益

6.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益--买卖权证差价收入。

6.4.7.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
期货投资	565,887.01

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,091,583.91
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	1,091,583.91

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
1.交易性金融资产	-5,205,935.99
——股票投资	-5,205,935.99
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-75,657.50
——权证投资	-
——期货投资	-75,657.50
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-2,468.06
合计	-5,279,125.43

注：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税中包含应税金融商品公允价值变动产生的预估税金及附加。

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
基金赎回费收入	10,593.48
转换费收入	438.07
合计	11,031.55

6.4.7.16 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2026年01月01日至2026年06月30日
审计费用	12,194.49
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	162.00
合计	71,863.86

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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的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

本报告期内存在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
财通基金管理有限公司（"财通基金"）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
财通证券股份有限公司（"财通证券"）	基金管理人的股东、基金代销机构
中国光大银行股份有限公司（"光大银行"）	基金托管人、基金代销机构

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均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01月01日至20 26年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至20 25年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	941,313.82	2,367,879.90
其中：应支付销售机构的客户维护费	332,837.65	1,042,337.92
应支付基金管理人的净管理费	608,476.17	1,325,541.98

注：(1)支付基金管理人的基金管理费按前一日基金资产净值的1.20%年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付；
(2)基金管理费计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.20%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026 年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	156,885.69	394,646.66

注：(1)支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值的0.20%年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付；
(2)基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未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

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
无。

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
无。

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

本基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

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于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

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		上年度可比期间	
	2026年01月01日至2026年06月30日		2025年01月01日至2025年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
光大银行	3,474,430.79	3,541.35	1,180,576.35	22,341.68

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项的说明。

6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

本基金本报告期及上年度可比期间均无当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300750	宁德时代	2026-04-24	6个月	询价转让	410.34	373.17	2,400	984,816.00	895,608.00	-
688795	摩尔线程	2025-11-26	6个月以上	新股限售	114.28	676.94	1,083	123,765.24	733,126.02	-
688802	沐曦股份	2025-12-09	6个月以上	新股限售	104.66	768.89	832	87,077.12	639,716.48	-
301666	大普微	2026-04-08	6个月	新股限售	46.08	463.33	218	10,045.44	101,005.94	-
688781	视涯科技	2026-03-18	6个月以上	新股限售	22.68	42.16	1,358	30,799.44	57,253.28	-
688808	联讯仪器	2026-04-16	6个月	新股限售	81.88	1,584.33	35	2,865.80	55,451.55	-
688818	电科蓝天	2026-02-03	6个月	新股限售	9.47	70.14	460	4,356.20	32,264.40	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6个月	新股限售	17.52	35.92	742	12,999.84	26,652.64	-
301682	宏明	2026-03-18	6个	新股	69.66	160.06	156	10,866.96	24,969.36	-

	电子		月	限售						
688785	恒运昌	2026-01-20	6个月	新股限售	92.18	463.15	52	4,793.36	24,083.80	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6个月	新股限售	26.28	172.09	117	3,074.76	20,134.53	-
688635	长进光子	2026-05-20	6个月	新股限售	40.98	308.19	59	2,417.82	18,183.21	-
001257	盛龙股份	2026-03-24	6个月	新股限售	7.82	20.74	662	5,176.84	13,729.88	-
688811	有研复材	2026-04-01	6个月	新股限售	6.41	24.13	451	2,890.91	10,882.63	-
603459	红板科技	2026-03-31	6个月	新股限售	17.70	84.32	109	1,929.30	9,190.88	-
301696	三瑞智能	2026-03-31	6个月	新股限售	24.68	86.80	105	2,591.40	9,114.00	-
301680	固德电材	2026-02-27	6个月	新股限售	58.00	112.16	52	3,016.00	5,832.32	-
301513	尚水智能	2026-04-10	6个月	新股限售	26.66	50.96	95	2,532.70	4,841.20	-
301683	慧谷新材	2026-03-24	6个月	新股限售	78.38	121.77	35	2,743.30	4,261.95	-
603352	至信股份	2026-01-08	6个月	新股限售	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603435	嘉德利	2026-05-15	6个月	新股限售	15.76	46.71	61	961.36	2,849.31	-
601112	振石股份	2026-01-21	6个月	新股限售	11.18	17.59	146	1,632.28	2,568.14	-
001220	世盟股份	2026-01-27	6个月	新股限售	28.00	27.78	46	1,288.00	1,277.88	-
603284	林平发展	2026-02-03	6个月	新股限售	37.88	34.87	34	1,287.92	1,185.58	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6个月	新股限售	33.49	33.93	25	837.25	848.25	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026-06-29	重大事項	832.00	2026-07-13	890.99	706	536,173.94	587,392.00	-

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

于2026年06月30日，本基金未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于2026年06月30日，本基金未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中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。本基金的管理人进行风险管理的主要目标是加强对投资风险的控制，保证基金资产的安全，维护基金份额持有人的利益；同时，提升基金投资组合的风险调整后收益水平，将以上各种风险控制在限定的范围之内，在基金的风险和收益之间取得最佳的平衡，实现“风险和收益相匹配”的投资目标，谋求基金资产的长期稳定增长。

本基金的基金管理人建立了董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系。董事会下设合规控制委员会，负责对公司风险管理战略和政策、内部控制及风险控制基本制度进行审定，对基本制度的执行情况、关联交易的合法合规性等进行监督和检查。董事会聘任督察长，负责公司及其基金运作的监察稽核工作。公司经营管理层负责公司日常经营管理中的风险控制工作，经营管理层下设投资决策委员会和风险控制委员会，负责对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和防控。公司各业务部门根据具体情况制定本部门的作业流程及风险控制制度，加强对风险的控制，作为一线责任人，将风险控制在最小范围内。同时，公司设独立的法律合规部和风险管理部，两者依各自职能对公司运作各环节的各类风险进行监控。

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对各类投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估，建立相应的分级别的交易对手库，并分别限定交易额度，同时采取一定的风险缓释措施。本基金的银行存款存放在本基金的托管人光大银行，还有部分存款存放在开立于本基金的结算机构海通证券、广发证券和中信证券华南股份有限公司的证券账户内，按银行同业利率计息，与该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、对手授信额度、价格偏离等方面进行限制以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

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

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严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，并对基金组合资产中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超过7个工作日可变现资产的可变现价值，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大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，因此除在附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期	1个月以内	1-3个月	3个月-1	1-5年	5年以上	不计息	合计
----	-------	-------	-------	------	------	-----	----

末 2026 年06 月30 日			年				
资产							
货币 资金	9,968,590.10	-	-	-	-	-	9,968,590.10
结算 备付 金	1,511,390.20	-	-	-	-	-	1,511,390.20
存出 保证 金	1,063,152.00	-	-	-	-	-	1,063,152.00
交易 性金 融资 产	-	-	-	-	-	86,754,353.18	86,754,353.18
应收 申购 款	-	-	-	-	-	291,960.10	291,960.10
资产 总计	12,543,132.30	-	-	-	-	87,046,313.28	99,589,445.58
负债							
应付 赎回 款	-	-	-	-	-	419,767.41	419,767.41
应付 管理 人报 酬	-	-	-	-	-	94,298.83	94,298.83
应付 托管	-	-	-	-	-	15,716.48	15,716.48

费							
应交 税费	-	-	-	-	-	7,241.29	7,241.29
其他 负债	-	-	-	-	-	72,357.56	72,357.56
负债 总计	-	-	-	-	-	609,381.57	609,381.57
利率 敏感 度缺 口	12,543,132.3 0	-	-	-	-	86,436,931.71	98,980,064.01
上年 度末 2025 年12 月31 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1 年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币 资金	24,648,343.8 2	-	-	-	-	-	24,648,343.82
结算 备付 金	10,425,096.9 8	-	-	-	-	-	10,425,096.98
存出 保证 金	1,828,886.40	-	-	-	-	-	1,828,886.40
交易 性金 融资 产	-	-	-	-	-	297,070,445.6 0	297,070,445.6 0
应收 申购 款	-	-	-	-	-	84,785.85	84,785.85

资产总计	36,902,327.20	-	-	-	-	297,155,231.45	334,057,558.65
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	592,758.09	592,758.09
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	342,757.11	342,757.11
应付托管费	-	-	-	-	-	57,126.18	57,126.18
应交税费	-	-	-	-	-	13,182.30	13,182.30
其他负债	-	-	-	-	-	155,684.00	155,684.00
负债总计	-	-	-	-	-	1,161,507.68	1,161,507.68
利率敏感度缺口	36,902,327.20	-	-	-	-	295,993,723.77	332,896,050.97

注：表中所示为本基金资产负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本期末及上年度末均未持有交易性固定收益类投资（不含可转换债券及可交换债券），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金可持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于证券市场的整体波动，以及单个证券发行主体的自身经营情况或特殊事件影响。

本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，进行积极的组合管理和风险控制，力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。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和跟踪偏离。本基金投资组合中，股票（含存托凭证）资产占基金资产的比例不低于80%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股占非现金基金资产的比例不低于80%。每个交易日日终在扣除股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	86,754,353.18	87.65	297,070,445.60	89.24
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-

一权证投资				
其他	-	-	-	-
合计	86,754,353.18	87.65	297,070,445.60	89.24

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.基金的市场价格风险决定于基金相对其业绩比较基准的贝塔系数，以及业绩比较基准的变动。		
	2.除业绩比较基准变动外，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
	3.贝塔系数的估计以过去一年的历史数据作为样本，采用线性回归法估计。		
	4.业绩比较基准的变动对基金的净值表现具有对称性影响。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
	业绩比较基准增加1%	956,230.21	3,217,205.56
	业绩比较基准减少1%	-956,230.21	-3,217,205.56

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 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	83,469,071.71	292,614,115.69

第二层次	587,392.00	975,534.75
第三层次	2,697,889.47	3,480,795.16
合计	86,754,353.18	297,070,445.60

6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资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，确定相关投资的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06月30日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2025年12月31日：无)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，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

于2026年06月30日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§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	86,754,353.18	87.11
	其中：股票	86,754,353.18	87.11
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	11,479,980.30	11.53
8	其他各项资产	1,355,112.10	1.36
9	合计	99,589,445.58	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	118,225.00	0.12
B	采矿业	3,451,612.60	3.49
C	制造业	44,023,078.18	44.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,091,732.22	2.11
E	建筑业	626,651.00	0.63
F	批发和零售业	491,460.00	0.50
G	交通运输、仓储和邮政业	1,846,727.00	1.87
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,281,234.50	4.33
J	金融业	12,938,427.47	13.07
K	房地产业	77,510.00	0.08
L	租赁和商务服务业	104,859.18	0.11
M	科学研究和技术服务业	1,294,904.00	1.31
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	3,064.46	0.00
R	文化、体育和娱乐业	11,090.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	71,360,575.61	72.10

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	3,125.00	0.00
B	采矿业	236,045.88	0.24
C	制造业	10,603,666.27	10.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	505,558.00	0.51
E	建筑业	45,791.20	0.05
F	批发和零售业	1,207,207.14	1.22
G	交通运输、仓储和邮政业	543,035.40	0.55
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	201,426.77	0.20
J	金融业	1,140,239.27	1.15
K	房地产业	12,187.36	0.01
L	租赁和商务服务业	1,230.60	0.00
M	科学研究和技术服务业	12,541.68	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	874,926.00	0.88
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,860.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	2,937.00	0.00
S	综合	-	-

	合计	15,393,777.57	15.55
--	----	---------------	-------

7.2.3 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通过港股通机制投资的港股。

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	3,899	4,951,730.00	5.00
2	300750	宁德时代	7,900	3,057,163.00	3.09
3	300502	新易盛	4,260	2,585,820.00	2.61
4	601899	紫金矿业	80,999	2,036,314.86	2.06
5	600519	贵州茅台	1,615	1,914,566.35	1.93
6	300408	三环集团	11,100	1,852,590.00	1.87
7	603986	兆易创新	2,200	1,793,000.00	1.81
8	601318	中国平安	32,900	1,570,646.00	1.59
9	603259	药明康德	10,400	1,294,904.00	1.31
10	002384	东山精密	4,700	1,233,045.00	1.25
11	002371	北方华创	1,370	1,211,847.20	1.22
12	688256	寒武纪	748	1,193,471.40	1.21
13	601288	农业银行	190,300	1,155,121.00	1.17
14	600030	中信证券	40,200	1,154,946.00	1.17
15	600522	中天科技	18,500	1,122,580.00	1.13
16	600183	生益科技	6,400	1,109,760.00	1.12
17	002463	沪电股份	7,200	1,100,160.00	1.11
18	600176	中国巨石	14,571	1,061,934.48	1.07
19	000333	美的集团	13,945	1,053,265.85	1.06
20	688012	中微公司	2,116	991,346.00	1.00
21	002916	深南电路	2,160	989,064.00	1.00

22	600900	长江电力	36,200	958,214.00	0.97
23	000776	广发证券	39,400	921,960.00	0.93
24	688111	金山办公	4,076	868,391.80	0.88
25	000001	平安银行	86,320	867,516.00	0.88
26	600036	招商银行	23,100	820,050.00	0.83
27	002558	巨人网络	29,200	804,752.00	0.81
28	600233	圆通速递	49,800	784,350.00	0.79
29	600150	中国船舶	22,276	752,706.04	0.76
30	002142	宁波银行	25,315	751,602.35	0.76
31	600919	江苏银行	69,451	748,681.78	0.76
32	600887	伊利股份	29,300	702,028.00	0.71
33	300476	胜宏科技	1,900	658,217.00	0.66
34	600886	国投电力	46,700	621,577.00	0.63
35	601009	南京银行	61,400	607,246.00	0.61
36	688072	拓荆科技	706	587,392.00	0.59
37	601229	上海银行	67,200	583,296.00	0.59
38	601077	渝农商行	92,400	564,564.00	0.57
39	002415	海康威视	16,100	550,620.00	0.56
40	605117	德业股份	5,157	547,570.26	0.55
41	601998	中信银行	78,400	543,312.00	0.55
42	601995	中金公司	14,800	535,020.00	0.54
43	600026	中远海能	28,800	516,672.00	0.52
44	000651	格力电器	13,500	506,250.00	0.51
45	600489	中金黄金	28,000	505,400.00	0.51
46	000807	云铝股份	22,700	502,578.00	0.51
47	601360	三六零	57,500	499,675.00	0.50
48	600426	华鲁恒升	20,200	483,184.00	0.49
49	601607	上海医药	31,000	477,400.00	0.48
50	601117	中国化学	63,400	465,990.00	0.47
51	688521	芯原股份	1,245	462,069.30	0.47
52	000338	潍柴动力	16,800	457,800.00	0.46

53	000895	双汇发展	16,700	374,080.00	0.38
54	688472	阿特斯	33,294	360,241.08	0.36
55	600674	川投能源	24,900	352,833.00	0.36
56	603799	华友钴业	7,300	352,298.00	0.36
57	301308	江波龙	500	351,900.00	0.36
58	300014	亿纬锂能	5,400	351,162.00	0.35
59	002709	天赐材料	6,800	349,724.00	0.35
60	002236	大华股份	21,000	346,290.00	0.35
61	000938	紫光股份	11,800	340,548.00	0.34
62	000425	徐工机械	39,700	321,173.00	0.32
63	600104	上汽集团	32,500	317,200.00	0.32
64	688396	华润微	3,202	312,355.10	0.32
65	002028	思源电气	1,800	311,400.00	0.31
66	600028	中国石化	69,800	311,308.00	0.31
67	600089	特变电工	13,643	306,967.50	0.31
68	002001	新和成	10,760	305,799.20	0.31
69	600989	宝丰能源	14,900	302,917.00	0.31
70	300394	天孚通信	1,000	302,680.00	0.31
71	002493	荣盛石化	27,800	298,850.00	0.30
72	300661	圣邦股份	2,080	298,438.40	0.30
73	600460	士兰微	5,400	295,164.00	0.30
74	601988	中国银行	49,200	281,424.00	0.28
75	002532	天山铝业	24,800	266,104.00	0.27
76	600050	中国联通	66,500	266,000.00	0.27
77	688008	澜起科技	826	255,977.40	0.26
78	601872	招商轮船	14,500	254,765.00	0.26
79	601877	正泰电器	10,000	250,700.00	0.25
80	000725	京东方A	28,000	243,040.00	0.25
81	002475	立讯精密	3,400	239,360.00	0.24
82	601012	隆基绿能	17,883	234,624.96	0.24
83	000301	东方盛虹	19,600	224,420.00	0.23

84	000708	中信特钢	17,400	219,588.00	0.22
85	000617	中油资本	32,300	212,857.00	0.22
86	600926	杭州银行	14,300	206,635.00	0.21
87	600741	华域汽车	12,600	195,552.00	0.20
88	688126	沪硅产业	4,836	192,908.04	0.19
89	002466	天齐锂业	3,100	190,092.00	0.19
90	688981	中芯国际	1,179	187,248.78	0.19
91	601088	中国神华	4,700	183,488.00	0.19
92	688041	海光信息	475	175,892.50	0.18
93	002648	卫星化学	7,100	166,779.00	0.17
94	000408	藏格矿业	2,400	166,368.00	0.17
95	601138	工业富联	2,200	158,730.00	0.16
96	601688	华泰证券	7,200	148,464.00	0.15
97	300450	先导智能	3,300	134,376.00	0.14
98	300316	晶盛机电	2,000	120,800.00	0.12
99	601881	中国银河	9,462	118,937.34	0.12
100	002736	国信证券	11,900	118,881.00	0.12
101	000988	华工科技	600	110,766.00	0.11
102	000166	申万宏源	24,600	108,240.00	0.11
103	601857	中国石油	12,000	104,160.00	0.11
104	601398	工商银行	14,400	101,808.00	0.10
105	603993	洛阳钼业	5,700	100,035.00	0.10
106	600438	通威股份	8,100	98,091.00	0.10
107	000858	五粮液	1,311	97,014.00	0.10
108	600346	恒力石化	5,300	93,863.00	0.09
109	000100	TCL科技	15,800	91,956.00	0.09
110	601601	中国太保	3,200	91,264.00	0.09
111	002074	国轩高科	3,300	90,783.00	0.09
112	601816	京沪高铁	19,500	88,335.00	0.09
113	601166	兴业银行	5,300	87,768.00	0.09
114	600584	长电科技	800	82,840.00	0.08

115	600031	三一重工	4,481	77,431.68	0.08
116	002353	杰瑞股份	500	76,250.00	0.08
117	601919	中远海控	5,600	74,256.00	0.08
118	601658	邮储银行	14,800	72,964.00	0.07
119	601225	陕西煤业	3,500	71,225.00	0.07
120	002050	三花智控	1,600	70,128.00	0.07
121	003816	中国广核	17,300	67,643.00	0.07
122	002714	牧原股份	1,900	66,481.00	0.07
123	600938	中国海油	2,400	65,160.00	0.07
124	601211	国泰海通	3,400	61,880.00	0.06
125	600406	国电南瑞	2,700	61,695.00	0.06
126	600690	海尔智家	2,900	59,189.00	0.06
127	000063	中兴通讯	1,600	57,904.00	0.06
128	300033	同花顺	240	57,840.00	0.06
129	002352	顺丰控股	1,800	56,268.00	0.06
130	000977	浪潮信息	800	56,000.00	0.06
131	600660	福耀玻璃	1,100	55,484.00	0.06
132	300433	蓝思科技	1,000	53,660.00	0.05
133	601628	中国人寿	1,500	53,025.00	0.05
134	600160	巨化股份	1,000	53,010.00	0.05
135	601328	交通银行	8,100	52,083.00	0.05
136	601600	中国铝业	6,300	51,786.00	0.05
137	300498	温氏股份	4,200	51,744.00	0.05
138	603501	豪威集团	545	51,693.25	0.05
139	002027	分众传媒	10,028	48,535.52	0.05
140	000568	泸州老窖	616	47,752.32	0.05
141	002837	英维克	600	47,736.00	0.05
142	601336	新华保险	800	47,728.00	0.05
143	600809	山西汾酒	400	43,748.00	0.04
144	002230	科大讯飞	1,000	40,840.00	0.04
145	601888	中国中免	746	40,067.66	0.04

146	601766	中国中车	7,667	39,868.40	0.04
147	600019	宝钢股份	7,200	39,096.00	0.04
148	601838	成都银行	2,171	38,426.70	0.04
149	603893	瑞芯微	200	37,672.00	0.04
150	600585	海螺水泥	2,200	37,290.00	0.04
151	601127	赛力斯	600	36,750.00	0.04
152	603288	海天味业	1,100	36,476.00	0.04
153	600000	浦发银行	4,200	36,162.00	0.04
154	600010	包钢股份	15,700	35,011.00	0.04
155	601669	中国电建	7,400	34,780.00	0.04
156	600941	中国移动	400	34,452.00	0.03
157	600795	国电电力	7,300	34,091.00	0.03
158	002625	光启技术	1,100	33,352.00	0.03
159	000538	云南白药	680	32,211.60	0.03
160	600066	宇通客车	1,200	32,172.00	0.03
161	002938	鹏鼎控股	300	31,614.00	0.03
162	002241	歌尔股份	1,400	31,542.00	0.03
163	300866	安克创新	300	31,350.00	0.03
164	601868	中国能建	11,500	30,705.00	0.03
165	600048	保利发展	6,400	29,632.00	0.03
166	600188	兖矿能源	1,662	29,533.74	0.03
167	002600	领益智造	1,700	29,478.00	0.03
168	600760	中航沈飞	700	28,770.00	0.03
169	601668	中国建筑	6,300	27,342.00	0.03
170	002311	海大集团	600	26,766.00	0.03
171	002049	紫光国微	300	26,625.00	0.03
172	300274	阳光电源	160	25,443.20	0.03
173	601939	建设银行	2,600	25,038.00	0.03
174	601728	中国电信	4,800	24,912.00	0.03
175	600016	民生银行	7,600	24,472.00	0.02
176	002920	德赛西威	300	24,450.00	0.02

177	688036	传音控股	411	24,228.45	0.02
178	601319	中国人保	3,300	22,308.00	0.02
179	000975	山金国际	1,300	22,100.00	0.02
180	601169	北京银行	4,500	22,050.00	0.02
181	600009	上海机场	900	20,790.00	0.02
182	001979	招商蛇口	3,000	19,290.00	0.02
183	000768	中航西飞	900	18,432.00	0.02
184	601898	中煤能源	1,500	18,270.00	0.02
185	600039	四川路桥	2,300	17,986.00	0.02
186	600600	青岛啤酒	344	17,967.12	0.02
187	601800	中国交建	3,100	17,701.00	0.02
188	300803	指南针	190	17,417.30	0.02
189	600362	江西铜业	400	17,320.00	0.02
190	600025	华能水电	1,900	16,891.00	0.02
191	601006	大秦铁路	3,600	16,596.00	0.02
192	300059	东方财富	800	16,304.00	0.02
193	600415	小商品城	1,600	16,256.00	0.02
194	000002	万科A	5,400	15,984.00	0.02
195	002594	比亚迪	200	15,940.00	0.02
196	000999	华润三九	680	15,293.20	0.02
197	600011	华能国际	1,900	14,421.00	0.01
198	000963	华东医药	500	14,060.00	0.01
199	688223	晶科能源	2,897	13,760.75	0.01
200	601825	沪农商行	1,800	13,482.00	0.01
201	601390	中国中铁	3,100	12,927.00	0.01
202	600015	华夏银行	2,000	12,780.00	0.01
203	605499	东鹏饮料	103	12,713.29	0.01
204	601377	兴业证券	2,100	12,684.00	0.01
205	600515	海南机场	4,600	12,604.00	0.01
206	600219	南山铝业	3,100	12,369.00	0.01
207	601186	中国铁建	2,000	11,900.00	0.01

208	300999	金龙鱼	500	11,630.00	0.01
209	601916	浙商银行	4,400	11,572.00	0.01
210	000157	中联重科	1,600	11,152.00	0.01
211	300251	光线传媒	1,000	11,090.00	0.01
212	603019	中科曙光	100	10,723.00	0.01
213	300628	亿联网络	300	10,146.00	0.01
214	000657	中钨高新	100	9,572.00	0.01
215	300124	汇川技术	136	9,020.88	0.01
216	600023	浙能电力	1,700	8,942.00	0.01
217	600549	厦门钨业	100	8,520.00	0.01
218	688303	大全能源	466	8,122.38	0.01
219	300418	昆仑万维	200	8,072.00	0.01
220	301165	锐捷网络	100	8,045.00	0.01
221	601689	拓普集团	140	7,898.80	0.01
222	002422	科伦药业	200	7,704.00	0.01
223	601618	中国中冶	3,000	7,320.00	0.01
224	600309	万华化学	100	6,841.00	0.01
225	600958	东方证券	700	6,608.00	0.01
226	600482	中国动力	200	6,560.00	0.01
227	000630	铜陵有色	1,000	6,360.00	0.01
228	600221	海航控股	4,700	6,345.00	0.01
229	600115	中国东航	1,600	6,096.00	0.01
230	601985	中国核电	674	6,086.22	0.01
231	600588	用友网络	600	5,508.00	0.01
232	600372	中航机载	500	5,425.00	0.01
233	600027	华电国际	1,200	5,340.00	0.01
234	600918	中泰证券	1,000	5,320.00	0.01
235	601456	国联民生	600	5,304.00	0.01
236	600061	国投资本	800	5,240.00	0.01
237	600018	上港集团	1,100	5,192.00	0.01
238	601238	广汽集团	1,000	5,080.00	0.01

239	600111	北方稀土	100	4,805.00	0.00
240	002202	金风科技	200	4,780.00	0.00
241	603369	今世缘	200	4,742.00	0.00
242	600803	新奥股份	300	4,740.00	0.00
243	300122	智飞生物	400	4,676.00	0.00
244	600029	南方航空	900	4,662.00	0.00
245	600085	同仁堂	200	4,622.00	0.00
246	002179	中航光电	100	4,620.00	0.00
247	600547	山东黄金	200	4,618.00	0.00
248	601633	长城汽车	300	4,527.00	0.00
249	600196	复星医药	200	4,494.00	0.00
250	688009	中国通号	917	4,364.92	0.00
251	601901	方正证券	600	4,320.00	0.00
252	601111	中国国航	700	4,235.00	0.00
253	601136	首创证券	300	4,185.00	0.00
254	601018	宁波港	1,300	4,095.00	0.00
255	001391	国货航	1,000	4,070.00	0.00
256	600893	航发动力	100	3,834.00	0.00
257	600845	宝信软件	200	3,326.00	0.00
258	601059	信达证券	200	3,238.00	0.00
259	300015	爱尔眼科	371	3,064.46	0.00
260	601698	中国卫通	100	3,025.00	0.00
261	603296	华勤技术	40	2,970.80	0.00
262	300413	芒果超媒	200	2,926.00	0.00
263	601066	中信建投	100	2,907.00	0.00
264	600875	东方电气	100	2,877.00	0.00
265	601878	浙商证券	300	2,850.00	0.00
266	601727	上海电气	400	2,800.00	0.00
267	603392	万泰生物	100	2,697.00	0.00
268	601058	赛轮轮胎	200	2,306.00	0.00
269	000625	长安汽车	300	2,151.00	0.00

270	600570	恒生电子	100	2,119.00	0.00
271	600930	华电新能	200	954.00	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	002266	浙富控股	155,800	788,348.00	0.80
2	688795	摩尔线程	1,083	733,126.02	0.74
3	688802	沐曦股份	832	639,716.48	0.65
4	688498	源杰科技	300	565,800.00	0.57
5	300475	香农芯创	1,700	510,000.00	0.52
6	300972	万辰集团	2,900	502,889.00	0.51
7	601528	瑞丰银行	107,600	475,592.00	0.48
8	002839	张家港行	119,100	464,490.00	0.47
9	301536	星宸科技	3,600	463,356.00	0.47
10	600801	华新建材	27,500	429,000.00	0.43
11	300857	协创数据	1,100	373,890.00	0.38
12	688002	睿创微纳	2,400	371,256.00	0.38
13	603345	安井食品	4,100	328,779.00	0.33
14	601233	桐昆股份	14,900	322,585.00	0.33
15	301031	中熔电气	2,400	286,680.00	0.29
16	000791	甘肃能源	37,200	282,720.00	0.29
17	601333	广深铁路	99,000	272,250.00	0.28
18	600535	天士力	20,300	268,569.00	0.27
19	603256	宏和科技	1,000	265,330.00	0.27
20	002850	科达利	1,300	246,090.00	0.25
21	688059	华锐精密	1,200	239,652.00	0.24
22	603699	纽威股份	4,600	231,380.00	0.23
23	688766	普冉股份	300	229,980.00	0.23

24	600295	鄂尔多斯	21,000	225,120.00	0.23
25	001221	悍高集团	5,500	221,210.00	0.22
26	301377	鼎泰高科	400	220,360.00	0.22
27	002216	三全食品	19,100	220,223.00	0.22
28	001286	陕西能源	21,700	220,038.00	0.22
29	600871	石化油服	108,200	219,646.00	0.22
30	000933	神火股份	10,300	218,360.00	0.22
31	605123	派克新材	2,200	213,422.00	0.22
32	688110	东芯股份	1,000	203,700.00	0.21
33	603579	荣泰健康	12,000	203,640.00	0.21
34	688308	欧科亿	1,100	199,991.00	0.20
35	300223	北京君正	800	199,120.00	0.20
36	688328	深科达	2,052	196,376.40	0.20
37	600901	江苏金租	33,840	194,580.00	0.20
38	000951	中国重汽	8,100	158,031.00	0.16
39	002468	申通快递	9,900	144,144.00	0.15
40	600037	歌华有线	21,900	137,313.00	0.14
41	600885	宏发股份	3,800	131,062.00	0.13
42	002120	韵达股份	19,100	121,476.00	0.12
43	688475	萤石网络	4,397	120,257.95	0.12
44	603317	天味食品	8,500	110,585.00	0.11
45	002568	百润股份	6,500	109,980.00	0.11
46	605189	富春染织	9,100	109,655.00	0.11
47	002154	报喜鸟	29,800	106,088.00	0.11
48	301666	大普微	218	101,005.94	0.10
49	300957	贝泰妮	3,200	100,832.00	0.10
50	000404	长虹华意	12,700	99,822.00	0.10
51	002867	周大生	8,900	99,235.00	0.10
52	002832	比音勒芬	4,600	94,944.00	0.10
53	002780	三夫户外	7,100	86,194.00	0.09
54	603338	浙江鼎力	1,700	72,250.00	0.07

55	300428	立中集团	3,800	69,084.00	0.07
56	002299	圣农发展	4,100	62,156.00	0.06
57	688809	强一股份	98	61,054.00	0.06
58	600323	瀚蓝环境	2,200	60,412.00	0.06
59	688781	视涯科技	1,358	57,253.28	0.06
60	300277	汽轮科技	3,800	57,152.00	0.06
61	688808	联讯仪器	35	55,451.55	0.06
62	601869	长飞光纤	100	54,590.00	0.06
63	603816	顾家家居	2,200	49,192.00	0.05
64	301682	宏明电子	256	42,578.36	0.04
65	600502	安徽建工	9,600	41,760.00	0.04
66	688818	电科蓝天	460	32,264.40	0.03
67	000709	河钢股份	16,500	32,010.00	0.03
68	688712	北芯生命	742	26,652.64	0.03
69	301109	军信股份	2,100	26,166.00	0.03
70	605016	百龙创园	1,000	25,850.00	0.03
71	002923	润都股份	2,600	24,596.00	0.02
72	688785	恒运昌	52	24,083.80	0.02
73	603352	至信股份	815	21,157.33	0.02
74	688813	泰金新能	117	20,134.53	0.02
75	688635	长进光子	59	18,183.21	0.02
76	000661	长春高新	264	17,582.40	0.02
77	001257	盛龙股份	662	13,729.88	0.01
78	001386	马可波罗	900	12,744.00	0.01
79	603198	迎驾贡酒	400	11,840.00	0.01
80	688811	有研复材	451	10,882.63	0.01
81	000729	燕京啤酒	1,000	10,130.00	0.01
82	688150	莱特光电	139	9,538.18	0.01
83	002701	奥瑞金	2,200	9,372.00	0.01
84	603459	红板科技	109	9,190.88	0.01
85	301696	三瑞智能	105	9,114.00	0.01

86	000848	承德露露	1,200	8,880.00	0.01
87	603175	超颖电子	69	6,147.21	0.01
88	301050	雷电微力	180	6,019.20	0.01
89	301680	固德电材	52	5,832.32	0.01
90	688080	映翰通	125	5,406.25	0.01
91	000031	大悦城	2,400	5,088.00	0.01
92	301513	尚水智能	95	4,841.20	0.00
93	300782	卓胜微	40	4,383.20	0.00
94	301683	慧谷新材	35	4,261.95	0.00
95	603092	德力佳	74	3,993.78	0.00
96	600377	宁沪高速	336	3,887.52	0.00
97	002833	弘亚数控	200	3,858.00	0.00
98	600322	津投城开	1,400	3,836.00	0.00
99	603262	技源集团	155	3,816.10	0.00
100	001233	海安集团	85	3,799.50	0.00
101	688408	中信博	118	3,793.70	0.00
102	688510	航亚科技	155	3,701.40	0.00
103	301667	纳百川	51	3,688.32	0.00
104	603610	麒盛科技	200	3,592.00	0.00
105	001390	古麒绒材	178	3,579.58	0.00
106	002955	鸿合科技	100	3,575.00	0.00
107	688819	天能股份	159	3,529.80	0.00
108	003008	开普检测	200	3,414.00	0.00
109	601236	红塔证券	500	3,410.00	0.00
110	688707	振华新材	253	3,251.05	0.00
111	600241	时代万恒	500	3,245.00	0.00
112	601231	环旭电子	100	3,240.00	0.00
113	605167	利柏特	200	3,220.00	0.00
114	001358	兴欣新材	122	3,152.48	0.00
115	603334	丰倍生物	88	3,126.64	0.00
116	600371	万向德农	500	3,125.00	0.00

117	002430	杭氧股份	100	3,096.00	0.00
118	600419	天润乳业	400	3,028.00	0.00
119	002949	华阳国际	300	2,967.00	0.00
120	600356	恒丰纸业	400	2,964.00	0.00
121	300655	晶瑞电材	138	2,955.96	0.00
122	603466	风语筑	300	2,937.00	0.00
123	603406	天富龙	113	2,932.35	0.00
124	603435	嘉德利	61	2,849.31	0.00
125	002576	通达动力	200	2,830.00	0.00
126	600116	三峡水利	500	2,800.00	0.00
127	603376	大明电子	111	2,750.58	0.00
128	603409	汇通控股	149	2,734.15	0.00
129	001308	康冠科技	130	2,711.80	0.00
130	603806	福斯特	160	2,686.40	0.00
131	000762	西藏矿业	100	2,670.00	0.00
132	603303	得邦照明	100	2,655.00	0.00
133	600694	大商股份	198	2,619.54	0.00
134	301017	漱玉平民	200	2,608.00	0.00
135	601112	振石股份	146	2,568.14	0.00
136	601588	北辰实业	1,600	2,560.00	0.00
137	001396	誉帆科技	69	2,443.98	0.00
138	603737	三棵树	100	2,410.00	0.00
139	688589	力合微	101	2,320.98	0.00
140	688687	凯因科技	142	2,316.02	0.00
141	603310	巍华新材	154	2,262.26	0.00
142	001387	雪祺电气	173	2,209.21	0.00
143	603183	建研院	600	2,130.00	0.00
144	002011	盾安环境	200	2,122.00	0.00
145	300457	赢合科技	100	2,108.00	0.00
146	002524	光正眼科	600	1,986.00	0.00
147	002139	拓邦股份	200	1,904.00	0.00

148	600774	汉商集团	300	1,878.00	0.00
149	300244	迪安诊断	100	1,874.00	0.00
150	003011	海象新材	100	1,817.00	0.00
151	603382	海阳科技	105	1,800.75	0.00
152	000932	华菱钢铁	500	1,735.00	0.00
153	002658	雪迪龙	200	1,690.00	0.00
154	002820	桂发祥	200	1,680.00	0.00
155	002790	瑞尔特	312	1,659.84	0.00
156	002495	佳隆股份	800	1,640.00	0.00
157	688289	圣湘生物	113	1,627.20	0.00
158	600648	外高桥	200	1,598.00	0.00
159	301449	天溯计量	41	1,586.70	0.00
160	603055	台华新材	200	1,558.00	0.00
161	688389	普门科技	153	1,497.87	0.00
162	002258	利尔化学	109	1,385.39	0.00
163	603215	比依股份	100	1,385.00	0.00
164	002030	达安基因	260	1,310.40	0.00
165	001220	世盟股份	46	1,277.88	0.00
166	002452	长高电气	100	1,277.00	0.00
167	603248	锡华科技	60	1,265.40	0.00
168	300532	今天国际	203	1,264.69	0.00
169	688089	嘉必优	117	1,241.37	0.00
170	002478	常宝股份	200	1,236.00	0.00
171	600826	兰生股份	140	1,230.60	0.00
172	603883	老百姓	110	1,205.60	0.00
173	603284	林平发展	34	1,185.58	0.00
174	600161	天坛生物	100	1,158.00	0.00
175	300036	超图软件	100	1,127.00	0.00
176	002085	万丰奥威	100	1,109.00	0.00
177	002507	涪陵榨菜	100	1,080.00	0.00
178	600908	无锡银行	200	1,016.00	0.00

179	001318	阳光乳业	100	991.00	0.00
180	300682	朗新科技	100	990.00	0.00
181	002293	罗莱生活	100	989.00	0.00
182	002405	四维图新	150	970.50	0.00
183	300729	乐歌股份	100	962.00	0.00
184	600197	伊力特	100	960.00	0.00
185	000957	中通客车	100	936.00	0.00
186	603027	千禾味业	130	906.10	0.00
187	603708	家家悦	100	858.00	0.00
188	603293	埃泰克	25	848.25	0.00
189	002116	中国海诚	120	811.20	0.00
190	600663	陆家嘴	112	703.36	0.00
191	601187	厦门银行	100	683.00	0.00
192	603421	鼎信通讯	100	615.00	0.00
193	603323	苏农银行	121	468.27	0.00
194	600507	方大特钢	100	405.00	0.00
195	603866	桃李面包	100	368.00	0.00
196	000401	金隅冀东	100	334.00	0.00
197	603082	北自科技	7	294.28	0.00
198	301638	南网数字	12	288.60	0.00
199	600022	山东钢铁	100	124.00	0.00

注：(1)自2026年07月28日起，股票代码为“688089”的股票名称由“嘉必优”变更为“ST嘉必优”；

(2)自2026年08月13日起，股票代码为“300223”的股票名称由“北京君正”变更为“君正股份”。

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	6,305,414.00	1.89
2	601899	紫金矿业	5,564,604.00	1.67
3	300308	中际旭创	5,366,147.00	1.61
4	600900	长江电力	5,214,727.00	1.57
5	601318	中国平安	5,050,393.00	1.52
6	603799	华友钴业	4,421,938.00	1.33
7	601288	农业银行	3,936,955.00	1.18
8	300750	宁德时代	3,762,583.00	1.13
9	002558	巨人网络	3,407,699.00	1.02
10	002028	思源电气	3,395,876.00	1.02
11	301031	中熔电气	3,351,130.00	1.01
12	600919	江苏银行	3,292,248.00	0.99
13	000333	美的集团	3,073,581.00	0.92
14	601009	南京银行	3,054,540.00	0.92
15	603993	洛阳钼业	3,006,255.00	0.90
16	600030	中信证券	2,969,604.00	0.89
17	688525	佰维存储	2,923,501.07	0.88
18	601398	工商银行	2,921,251.00	0.88
19	600036	招商银行	2,897,206.00	0.87
20	002463	沪电股份	2,844,053.00	0.85

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	300308	中际旭创	13,012,232.00	3.91
2	300502	新易盛	12,305,443.00	3.70
3	300750	宁德时代	12,060,442.00	3.62
4	601899	紫金矿业	10,677,746.00	3.21

5	600036	招商银行	9,109,728.33	2.74
6	601318	中国平安	8,477,918.00	2.55
7	600519	贵州茅台	8,367,280.00	2.51
8	600900	长江电力	8,168,152.00	2.45
9	600919	江苏银行	8,006,031.00	2.40
10	601398	工商银行	6,135,710.00	1.84
11	000333	美的集团	6,089,214.00	1.83
12	601288	农业银行	5,458,609.00	1.64
13	002028	思源电气	5,208,825.00	1.56
14	603799	华友钴业	4,863,860.00	1.46
15	300059	东方财富	4,857,618.00	1.46
16	000791	甘肃能源	4,605,964.00	1.38
17	601336	新华保险	4,593,473.51	1.38
18	002475	立讯精密	4,530,703.00	1.36
19	601009	南京银行	4,522,636.00	1.36
20	600030	中信证券	4,195,010.00	1.26

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

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	409,480,063.02
卖出股票收入（成交）总额	635,193,117.40

注：本表“买入股票成本（成交）总额”，“卖出股票收入（成交）总额”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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

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

本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。套期保值主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

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

本基金暂不投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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 报告期内，本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同约定的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	1,063,152.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	291,960.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,355,112.10

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产 净值比例(%)	流通受限情况说 明
1	300750	宁德时代	895,608.00	0.90	询价转让

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产 净值比例(%)	流通受限情况说 明
1	688795	摩尔线程	733,126.02	0.74	科创板打新限售
2	688802	沐曦股份	639,716.48	0.65	科创板打新限售

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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	持有份额	占总份

			额比例		额比例
4,083	13,427.53	980,055.93	1.79%	53,844,536.23	98.21%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	41,403.38	0.08%

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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2022年12月21日)基金份额总额	119,111,800.66
本报告期期初基金份额总额	202,730,330.69
本报告期基金总申购份额	17,438,856.93
减：本报告期基金总赎回份额	165,344,595.46
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	54,824,592.16

注：总申购份额含红利再投、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

本基金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、本报告期内，本基金管理人无重大人事变动。
- 2、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

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内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

因内部控制需要，经履行适当程序，本基金管理人于2026年4月2日将本基金会计师事务所由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）改聘为德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）。

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，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，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

本报告期内，本基金托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰海通证券	2	156,308,079.09	14.98%	29,060.92	14.69%	-
广发	3	250,725,731.69	24.04%	46,609.33	23.56%	-

证券						
中信 证券 华南	3	636,072,314.92	60.98%	122,122.12	61.74%	-

注：1、选择证券公司参与证券交易的标准

公司结合证券公司的财务状况、经营情况、合规风控能力、交易能力和研究能力完善证券公司的选择标准，证券交易单元所属证券公司需满足以下要求：

- (1)经营行为规范、合规内控制度健全；
- (2)具备高效、安全运作的通讯条件和稳定的交易系统，满足基金投资交易需求；
- (3)具备良好的市场形象和财务状况；
- (4)具备较强的研究及综合服务能力，具有专门的研究机构和专职研究人员；
- (5)被动股票型基金选择合作券商原则上应优先考虑交易服务能力。

公司对券商的服务评价严格遵循法律法规的相关要求，严禁与基金销售规模、保有规模挂钩，严禁以任何形式向证券公司承诺基金证券交易量及佣金或利用交易佣金与证券公司进行利益交换，严禁向第三方转移支付费用。被动股票型基金不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用。

2、选择证券公司参与证券交易的程序

- (1)公司建立交易单元管理审议机制，开展证券公司选择、协议签订、服务评价、交易佣金分配等审查机制，法律合规部及风险管理部进行前置性审查。
- (2)证券公司交易单元的办理由研究条线发起审批，经审批完成后，由相关部门办理后开通使用。研究条线每季度牵头对券商服务质量开展评价，根据券商服务评价结果，由公司审议当季股票交易量分配计划。
- (3)公司建立交易、投研、销售等业务隔离机制，基金销售业务人员不得参与证券公司选择、协议签订、服务评价、交易佣金分配等业务环节。

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

本基金本报告期内未租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资。

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	财通沪深300指数增强型证券投资基金2025年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2026-01-22

2	财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（2025年度）	中国证监会规定媒介	2026-03-28
3	财通沪深300指数增强型证券投资基金2025年年度报告	中国证监会规定媒介	2026-03-31
4	财通基金管理有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所的公告	中国证监会规定媒介	2026-04-02
5	财通沪深300指数增强型证券投资基金2026年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2026-04-22
6	财通基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会规定媒介	2026-04-28

§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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2026-01-01至2026-01-11	83,734,697.75	-	83,734,697.75	-	-
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、财通沪深300指数增强型证券投资基金基金合同；
- 3、财通沪深300指数增强型证券投资基金托管协议；
- 4、财通沪深300指数增强型证券投资基金招募说明书及其更新；
- 5、报告期内披露的各项公告；
- 6、法律法规要求备查的其他文件。

12.2 存放地点

上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心43、45楼。

12.3 查阅方式

投资者可在本基金管理人网站上免费查阅备查文件，对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人。

咨询电话：400-820-9888

公司网址：www.ctfund.com

财通基金管理有限公司
二〇二六年八月二十九日