

汇安中证 500 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:汇安基金管理有限责任公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

送出日期:2026 年 08 月 31 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年8月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年1月1日起至2026年6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§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	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18
6.3 净资产变动表	20
6.4 报表附注	22
§7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
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	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	64
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	66
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	66
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	66
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	66
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	66
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	66
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	66
7.12 投资组合报告附注	66
§8 基金份额持有人信息	67

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	67
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	68
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	68
§9 开放式基金份额变动	69
§10 重大事件揭示	69
10.1 基金份额持有人大会决议	69
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	69
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	69
10.4 基金投资策略的改变	69
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	69
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	69
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	70
10.8 其他重大事件	71
§11 影响投资者决策的其他重要信息	72
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	72
§12 备查文件目录	72
12.1 备查文件目录	72
12.2 存放地点	72
12.3 查阅方式	72

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇安中证500指数增强型证券投资基金	
基金简称	汇安中证500增强	
基金主代码	010157	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年11月16日	
基金管理人	汇安基金管理有限责任公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	44,545,893.70份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇安中证500增强A	汇安中证500增强C
下属分级基金的交易代码	010157	010158
报告期末下属分级基金的份额总额	29,357,426.83份	15,188,466.87份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型基金，在严格控制对中证500指数跟踪误差的基础上，通过量化投资方式进行积极的组合管理和风险控制，力求实现超越中证500指数的投资收益，谋求基金财产的长期增值。
投资策略	本基金为增强型股票指数基金，在标的指数成分股权重的基础上根据量化模型优化投资组合，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越目标指数的投资收益。 1、资产配置策略 2、股票投资策略 3、债券投资策略 4、资产支持证券投资策略 5、股指期货投资策略 6、国债期货投资策略 7、参与融资及转融通证券出借业务的策略 8、存托凭证投资策略

业绩比较基准	中证500指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金为指数型基金，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		汇安基金管理有限责任公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	郭冬青	张姗
	联系电话	010-56711600	400-61-95555
	电子邮箱	guodq@huianfund.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		010-56711690	400-61-95555
传真		010-56711640	0755-83195201
注册地址		上海市虹口区欧阳路218弄1号2楼215室	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		北京市东城区东直门南大街5号中青旅大厦13层；上海市虹口区东大名路501号白玉兰大厦36层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		100007	518040
法定代表人		刘强	缪建民

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.huianfund.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人办公地点

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	汇安基金管理有限责任公司	上海市虹口区东大名路501号上海白玉兰广场36层02单元

§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)	
	汇安中证500增强A	汇安中证500增强C
本期已实现收益	5,656,494.74	3,210,971.67
本期利润	7,137,020.30	4,142,466.36
加权平均基金份额本期利润	0.2245	0.2076
本期加权平均净值利润率	17.64%	16.69%
本期基金份额净值增长率	18.56%	18.33%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2026年06月30日)	
	汇安中证500增强A	汇安中证500增强C
期末可供分配利润	10,980,720.53	5,216,560.60
期末可供分配基金份额利润	0.3740	0.3435
期末基金资产净值	40,338,147.36	20,405,027.47
期末基金份额净值	1.3740	1.3435
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2026年06月30日)	
	汇安中证500增强A	汇安中证500增强C
基金份额累计净值增长率	37.40%	34.35%

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、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分余额的孰低数。

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

汇安中证500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	16.55%	1.57%	17.61%	1.56%	-1.06%	0.01%
过去六个月	18.56%	1.55%	19.93%	1.58%	-1.37%	-0.03%
过去一年	46.47%	1.29%	49.68%	1.35%	-3.21%	-0.06%
过去三年	52.04%	1.29%	48.15%	1.41%	3.89%	-0.12%
过去五年	26.31%	1.23%	31.61%	1.30%	-5.30%	-0.07%
自基金合同 生效起至今	37.40%	1.20%	41.60%	1.26%	-4.20%	-0.06%

汇安中证500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	16.44%	1.57%	17.61%	1.56%	-1.17%	0.01%
过去六个月	18.33%	1.55%	19.93%	1.58%	-1.60%	-0.03%
过去一年	45.89%	1.29%	49.68%	1.35%	-3.79%	-0.06%
过去三年	50.25%	1.29%	48.15%	1.41%	2.10%	-0.12%
过去五年	23.81%	1.23%	31.61%	1.30%	-7.80%	-0.07%
自基金合同 生效起至今	34.35%	1.20%	41.60%	1.26%	-7.25%	-0.06%

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

汇安中证500增强A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2020年11月16日-2026年06月30日)



汇安中证500增强C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2020年11月16日-2026年06月30日)



注：本报告期，本基金投资比例符合基金合同要求。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为汇安基金管理有限责任公司，于2016年4月19日获中国证监会批复，2016年4月25日正式成立，是业内首家全自然人、由内部核心专业人士控股的公募基金

管理公司，注册资本1亿元人民币，注册地为上海市，设北京、上海双总部。公司目前具有公开募集证券投资基金管理、基金销售、特定客户资产管理的资格。

截至2026年6月30日，公司旗下管理71只公募基金：

汇安丰融灵活配置混合型证券投资基金
 汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金
 汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金
 汇安嘉源纯债债券型证券投资基金
 汇安丰利灵活配置混合型证券投资基金
 汇安丰泽灵活配置混合型证券投资基金
 汇安沪深300指数增强型证券投资基金
 汇安嘉裕纯债债券型证券投资基金
 汇安多策略灵活配置混合型证券投资基金
 汇安资产轮动灵活配置混合型证券投资基金
 汇安裕华纯债定期开放债券型发起式证券投资基金
 汇安成长优选灵活配置混合型证券投资基金
 汇安稳裕债券型证券投资基金
 汇安趋势动力股票型证券投资基金
 汇安量化优选灵活配置混合型证券投资基金
 汇安裕阳三年持有期混合型证券投资基金
 汇安短债债券型证券投资基金
 汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金
 富时中国A50交易型开放式指数证券投资基金
 汇安核心成长混合型证券投资基金
 汇安鼎利纯债债券型证券投资基金
 汇安多因子混合型证券投资基金
 汇安行业龙头混合型证券投资基金
 汇安中短债债券型证券投资基金
 汇安嘉诚债券型证券投资基金
 汇安量化先锋混合型证券投资基金
 汇安中债-广西壮族自治区公司信用类债券指数证券投资基金
 汇安宜创量化精选混合型证券投资基金
 汇安嘉盛纯债债券型证券投资基金
 汇安信利债券型证券投资基金
 汇安裕和纯债债券型证券投资基金
 汇安上证证券交易型开放式指数证券投资基金

汇安嘉利混合型证券投资基金
汇安核心资产混合型证券投资基金
汇安裕鑫12个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金
汇安价值蓝筹混合型证券投资基金
汇安消费龙头混合型证券投资基金
汇安恒鑫12个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金
汇安中证500指数增强型证券投资基金
汇安泓阳三年持有期混合型证券投资基金
汇安恒利39个月定期开放纯债债券型证券投资基金
汇安盛鑫三年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金
汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金
汇安均衡优选混合型证券投资基金
汇安核心价值混合型证券投资基金
汇安鑫利优选混合型证券投资基金
汇安泓利一年持有期混合型证券投资基金
汇安鑫泽稳健一年持有期混合型证券投资基金
汇安信泰稳健一年持有期混合型证券投资基金
汇安优势企业精选混合型证券投资基金
汇安永利30天持有期短债债券型证券投资基金
汇安润阳三年持有期混合型证券投资基金
汇安永福90天持有期中短债债券型证券投资基金
汇安裕同纯债债券型证券投资基金
汇安添利18个月持有期混合型证券投资基金
汇安远见成长混合型证券投资基金
汇安品质优选混合型证券投资基金
汇安价值先锋混合型证券投资基金
汇安裕盈纯债债券型证券投资基金
汇安裕泰纯债债券型证券投资基金
汇安中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金
汇安均衡成长混合型证券投资基金
汇安行业优选混合型证券投资基金
汇安中债0-3年政策性金融债指数证券投资基金
汇安景气成长混合型证券投资基金
汇安中证A500指数证券投资基金
汇安裕宏利率债债券型证券投资基金

汇安聚利债券型证券投资基金
汇安质选增利债券型证券投资基金
汇安中证红利低波动100指数型证券投资基金
汇安成长领航混合型证券投资基金

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
柳预才	策略量化组基金经 理、本基金的基金经 理	2022- 12-23	-	13年	柳预才先生，上海财经大学数量金融学硕士研究生，13年证券、基金行业从业经验。曾任上海东方证券资产管理有限公司量化投资部研究助理、研究员；安信基金管理有限责任公司量化投资部研究员；农银汇理基金管理有限公司研究部研究员。2020年11月加入汇安基金管理有限责任公司，担任策略量化组基金经理。2021年9月3日至2023年6月19日，任汇安成长优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2023年9月27日至2024年12月23日，任汇安量化优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2024年7月19日至2026年3月3日，任汇安鑫泽稳健一年持有期混合型证券投资基金基金经理；2020年12月30日

					至今，任汇安宜创量化精选混合型证券投资基金基金经理；2022年12月23日至至今，任汇安中证500指数增强型证券投资基金基金经理；2023年5月29日至今，任汇安多因子混合型证券投资基金基金经理；2023年6月6日至今，任汇安多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2023年9月27日至今，任汇安沪深300指数增强型证券投资基金基金经理；2025年5月27日至今，任汇安聚利债券型证券投资基金基金经理；2025年9月5日至今，任汇安中证红利低波动100指数型证券投资基金基金经理；2026年6月4日至今，任汇安嘉利混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

1、上述任职日期、离职日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

2、本基金无基金经理助理。

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

本报告期末本基金的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守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规的规定及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的约定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，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。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理人公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，完善相应制度及流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，确保公平交易原则的实现。基金管理人公平对待旗下管理的所有投资组合，报告期内公平交易制度得到良好的贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的情况。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗口下（如：1日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易开展交易价差分析。分析结果表明，本报告期内公司对各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，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，本基金未发现可能的异常交易情况，不存在所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的5%的情况。

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

回顾今年上半年，最显著的市场特征不是“普涨”而是“结构分化”。A股大部分宽基指数在报告期内收涨，但内部呈现出典型的K型分化：以AI算力、半导体、光模块为代表的“硬科技”链条走出独立牛市，带动科创50指数上半年上涨超过60%，创业板指上涨超过35%，同期沪深300指数仅上涨7.6%。而行业层面看分化更为巨大：申万电子、通信大幅上涨，而还有行业（如农林牧渔、美容护理）下跌超过20%。2025年延续至今的行情不是“总量牛市”，更多的是科技板块的牛市，其他大部分个股的涨幅并未跟上。报告期内，全市场仅约30%的个股上涨，本质上是产业发展趋势的高强度兑现，少数高景气赛道“虹吸”了其他大部分股票的流动性与估值弹性。

报告期内，两条线索交织驱动着全球宏观主线：全球的AI景气周期与中东地缘冲击。前者推动全球（尤其是中美两国）的科技成长股、尤其是半导体与硬科技资产领涨；后者通过霍尔木兹海峡对油价的冲击，改变通胀预期与全球货币政策，进而压制部分大类资产（如债券和黄金）、放大全球资产波动。从配置角度看，在这样的高波动环境下，确定性的高景气板块，成为了资金追逐的主要方向，长久期债券与缺乏盈利支撑的传统板块承压。

在这样的市场背景下，本管理人一以贯之的量化投资策略在一定程度上处于逆风期（尤其是6月中下旬），这并非投资策略的失效，而是量化策略产生超额收益所需的“广

谱分散、风格不极致”环境与当前市场并不适配。而在高景气主线中“行业集中+个股集中”的投资方式，更易在少数主线资产上获取高弹性收益。本管理人在此过程中，也在不断迭代量化投资框架，将行业景气度更多地纳入考量范围，努力在组合中更多地体现我国科技领域日新月异进步的时代特征。

复盘A股历轮波澜壮阔的大行情，虽然过程不尽相同，但都是从“这次不一样”的星辰大海，回归到“每次都一样”的脚踏实地。毋庸置疑，推动人类文明发展的科技进步是星辰大海，但是否也需要适度考虑为梦想充值的性价比？因此，在适度参与这轮行情的过程中，本管理人也保持着相对审慎的态度。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末汇安中证500增强A基金份额净值为1.3740元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为18.56%，同期业绩比较基准收益率为19.93%；截至报告期末汇安中证500增强C基金份额净值为1.3435元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为18.33%，同期业绩比较基准收益率为19.93%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从当前已披露的中报预告、产业发展趋势和宏观数据看，未来半年仍有不小的概率是结构性行情。科技板块大幅上涨后，市场状态或将从主线集中的“估值扩张”逐步转向板块扩散的“盈利兑现”，可适当关注如下一些景气程度高，盈利确定性较强的板块：

1) 国产存储产业链：兼具周期上行与国产替代双重核心优势，涵盖DRAM、NAND、特色存储、存储模组、企业级存储、半导体设备、配套半导体材料及先进封装、存储控制芯片等全环节。当前行业受益于全球存储价格回暖、AI硬件拉动高端存储需求、国内晶圆厂持续扩产，叠加国产设备材料验证落地提速，整体成长确定性强。重点关注拥有核心技术壁垒、通过头部客户验证、市场份额持续提升的优质标的。

2) 半导体设备、材料与先进封装：行业投资逻辑已实现了从技术突破转向规模化交付、生态搭建、商业化落地的迭代。相较于半导体设计企业，设备和材料企业客户粘性高、国产化提升空间充足，下游晶圆厂扩产带来稳定订单，业绩可跟踪性强，且受单一产品迭代风险影响较小。同时，先进封装深度受益于AI芯片、高带宽存储、Chiplet技术发展，是未来2-3年半导体行业明确的资本开支方向，具备稳定的成长属性。

3) 创新药：行业基本面持续边际改善，核心源于药企海外授权BD收入的增长、临床研发成果持续落地、国内医保支付环境优化。与此同时，国内医药研发的效率与成本优势，逐渐获得全球市场认可。行业内部分化显著，需聚焦拥有真实临床价值、具备海外商业化能力、现金流充沛、管线布局清晰的优质标的。

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》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，公司运营总监担任估值委员会主席，投资部门、合规风控部和运营部指定人员担任委员。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未发生利润分配情况。

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，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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：汇安中证500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 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	3,820,181.85	6,341,385.35
结算备付金		1,026.84	1,023.18
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	57,363,912.13	63,945,610.64
其中：股票投资		57,363,912.13	63,945,610.64
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		15,815.18	188,940.46
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		61,200,936.00	70,476,959.63

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		338,160.07	527,271.44
应付管理人报酬		50,131.39	59,474.67
应付托管费		10,026.29	11,894.94
应付销售服务费		7,497.47	9,298.23
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	51,945.95	100,002.68
负债合计		457,761.17	707,941.96
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	44,545,893.70	60,689,289.50
未分配利润	6.4.7.8	16,197,281.13	9,079,728.17
净资产合计		60,743,174.83	69,769,017.67
负债和净资产总计		61,200,936.00	70,476,959.63

注：报告截止日2026年6月30日，基金份额总额44,545,893.70份，其中汇安中证500增强A基金份额净值1.3740元，份额总额29,357,426.83份；汇安中证500增强C基金份额净值1.3435元，份额总额15,188,466.87份。

6.2 利润表

会计主体：汇安中证500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		11,768,472.35	4,948,845.50
1.利息收入		2,346.41	3,009.93
其中：存款利息收入	6.4.7.9	2,346.41	2,935.30
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		-	74.63
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		9,341,486.99	3,175,542.62
其中：股票投资收益	6.4.7.10	8,922,991.85	2,408,186.03
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	2,605.29
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	-	-
股利收益	6.4.7.15	418,495.14	764,751.30
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	2,412,020.25	1,767,401.79
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	12,618.70	2,891.16
减：二、营业总支出		488,985.69	633,838.00
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	323,879.70	396,483.78

2.托管费	6.4.10.2.2	64,775.93	79,296.79
3.销售服务费	6.4.10.2.3	49,212.33	63,400.71
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		-	-
8.其他费用	6.4.7.18	51,117.73	94,656.72
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		11,279,486.66	4,315,007.50
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		11,279,486.66	4,315,007.50
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		11,279,486.66	4,315,007.50

6.3 净资产变动表

会计主体：汇安中证500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	60,689,289.50	9,079,728.17	69,769,017.67
二、本期期初净资产	60,689,289.50	9,079,728.17	69,769,017.67
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-16,143,395.80	7,117,552.96	-9,025,842.84

（一）、综合收益总额	-	11,279,486.66	11,279,486.66
（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）	-16,143,395.80	-4,161,933.70	-20,305,329.50
其中：1.基金申购款	14,769,181.51	3,755,576.14	18,524,757.65
2.基金赎回款	-30,912,577.31	-7,917,509.84	-38,830,087.15
（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	44,545,893.70	16,197,281.13	60,743,174.83
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	92,648,057.62	-10,864,671.16	81,783,386.46
二、本期期初净资产	92,648,057.62	-10,864,671.16	81,783,386.46
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-5,148,318.25	4,841,906.94	-306,411.31
（一）、综合收益总额	-	4,315,007.50	4,315,007.50
（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）	-5,148,318.25	526,899.44	-4,621,418.81

列)			
其中：1.基金申购款	3,127,710.77	-385,922.95	2,741,787.82
2.基金赎回款	-8,276,029.02	912,822.39	-7,363,206.63
(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	87,499,739.37	-6,022,764.22	81,476,975.15

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：

刘强

王嘉浩

江士

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

汇安中证500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[2020]1934号《关于准予汇安中证500指数增强型证券投资基金注册的批复》注册，由汇安基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇安中证500指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币556,920,351.09元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第0999号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《汇安中证500指数增强型证券投资基金基金合同》于2020年11月16日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为556,977,271.25份基金份额，其中认购资金利息折合56,920.16份基金份额。本基金的基金管理人为汇安基金管理有限责任公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《汇安中证500指数增强型证券投资基金基金合同》和《汇安中证500指数增强型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据认购/申购费和销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购基金时收取认购/申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用，而是从本类别

基金资产中计提销售服务费，并在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为C类基金份额。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇安中证500指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、存托凭证、债券(包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券)、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可以根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为：本基金股票资产投资比例不低于基金资产的80%；其中投资于中证500指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例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。股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：中证500指数收益率 $\times 95\%$ +银行活期存款利率(税后) $\times 5\%$ 。

本财务报表由本基金的基金管理人汇安基金管理有限责任公司于2026年8月27日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的中国证监会颁布的《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》、《汇安中证500指数增强型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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

本基金财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2026年6月30日的财务状况以及2026年1月1日至2026年6月30日的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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《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[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、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《财政部 税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，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，可以选择适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

2027年12月31日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。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，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。

(2) 对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，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 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	411,900.36
等于：本金	411,878.62
加：应计利息	21.74
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	3,408,281.49
等于：本金	3,408,215.13
加：应计利息	66.36
减：坏账准备	-
合计	3,820,181.85

注：其他存款本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		51,145,219.87	-	57,363,912.13	6,218,692.26
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		51,145,219.87	-	57,363,912.13	6,218,692.26

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	7.38
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-审计费	9,916.99
预提费用-信息披露费	39,671.58
其他应付	2,350.00
合计	51,945.95

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 汇安中证500增强A

金额单位：人民币元

项目 (汇安中证500增强A)	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	36,658,637.83	36,658,637.83
本期申购	3,234,245.94	3,234,245.94
本期赎回（以“-”号填列）	-10,535,456.94	-10,535,456.94
本期末	29,357,426.83	29,357,426.83

6.4.7.7.2 汇安中证500增强C

金额单位：人民币元

项目 (汇安中证500增强C)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	24,030,651.67	24,030,651.67
本期申购	11,534,935.57	11,534,935.57
本期赎回（以“-”号填列）	-20,377,120.37	-20,377,120.37
本期末	15,188,466.87	15,188,466.87

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

6.4.7.8.1 汇安中证500增强A

单位：人民币元

项目 (汇安中证500增强A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,781,284.71	-1,955,200.33	5,826,084.38
本期期初	7,781,284.71	-1,955,200.33	5,826,084.38
本期利润	5,656,494.74	1,480,525.56	7,137,020.30
本期基金份额交易产生的变动数	-2,030,041.00	47,656.85	-1,982,384.15
其中：基金申购款	965,664.83	-81,812.67	883,852.16
基金赎回款	-2,995,705.83	129,469.52	-2,866,236.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,407,738.45	-427,017.92	10,980,720.53

6.4.7.8.2 汇安中证500增强C

单位：人民币元

项目 (汇安中证500增强C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,535,537.40	-1,281,893.61	3,253,643.79
本期期初	4,535,537.40	-1,281,893.61	3,253,643.79
本期利润	3,210,971.67	931,494.69	4,142,466.36

本期基金份额交易产生的变动数	-2,296,267.81	116,718.26	-2,179,549.55
其中：基金申购款	3,153,460.56	-281,736.58	2,871,723.98
基金赎回款	-5,449,728.37	398,454.84	-5,051,273.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,450,241.26	-233,680.66	5,216,560.60

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	1,383.24
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	959.51
结算备付金利息收入	3.66
其他	-
合计	2,346.41

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	76,302,998.67
减：卖出股票成本总额	67,308,206.42
减：交易费用	71,800.40
买卖股票差价收入	8,922,991.85

6.4.7.10.2 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

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

无。

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13 贵金属投资收益

6.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

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

无。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.15 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	418,495.14
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	418,495.14

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01月01日至2026年06月30日
1.交易性金融资产	2,412,020.25
——股票投资	2,412,020.25
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-

减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	2,412,020.25

6.4.7.17 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	12,020.22
转换费收入	598.48
合计	12,618.70

6.4.7.18 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	9,916.99
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
汇划手续费	1,510.25
存托服务费	18.91
合计	51,117.73

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方、关联关系

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

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇安基金管理有限责任公司	基金管理人、基金登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
何斌	基金管理人的股东
秦军	基金管理人的股东
郭小峰	基金管理人的股东
任建辉	基金管理人的股东
刘强	基金管理人的股东
郭兆强	基金管理人的股东
尹喜杰	基金管理人的股东
王福德	基金管理人的股东

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

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至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	323,879.70	396,483.78
其中：应支付销售机构的客户维护费	122,395.26	157,175.53
应支付基金管理人的净管理费	201,484.44	239,308.25

注：支付基金管理人汇安基金管理有限责任公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.00%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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.00\% / \text{当年天数}。$$

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	64,775.93	79,296.79

注：支付基金托管人招商银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.20%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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇安中证500增强A	汇安中证500增强C	合计
汇安基金 管理有限 责任公司	0.00	1.20	1.20
招商银行 股份有限	0.00	18,507.82	18,507.82

公司			
合计	-	18,509.02	18,509.02
获得销售 服务费的 各关联方 名称	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销售服务费		
	汇安中证500增强A	汇安中证500增强C	合计
汇安基金 管理有限 责任公司	0.00	18.95	18.95
招商银行 股份有限 公司	0.00	31,118.13	31,118.13
合计	-	31,137.08	31,137.08

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给汇安基金管理有限责任公司，再由汇安基金管理有限责任公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费＝前一日C类基金份额的基金资产净值 × 0.40%/ 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 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

无。

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

无。

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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	411,900.36	1,383.24	356,603.05	497.37

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行股份有限公司保管，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

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

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

无。

6.4.12 期末（2026年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301308	江波龙	2026-01-26	1-6个月（含）	询价转让限售	212.09	675.52	1,000	212,090.00	675,520.00	-
688099	晶晨股份	2026-01-2	1-6个月（含）	询价转让	82.85	99.72	2,000	165,700.00	199,440.00	-

		8		限售						
688147	微导纳米	2026-04-07	1-6个月（含）	询价转让限售	57.10	147.02	1,000	57,100.00	147,020.00	-
300900	广联航空	2026-03-04	1-6个月（含）	询价转让限售	27.16	36.06	2,000	54,320.00	72,120.00	-
001248	华润新能源	2026-06-23	1个月内（含）	新股未上市	10.11	10.11	500	5,055.00	5,055.00	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起6个月内不得转让。

3、基金作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起12个月内不得转让。

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后6个月内不得转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 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

本基金为股票型基金，其风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过管理及信息系统持续监控上述各类风险。

公司建立董事会领导下的风险管理体系，包括董事会的下设的风险控制委员会、总经理下设的风险管理委员会、督察长、合规风控部以及各个业务部门组成。

公司致力于实行全面、系统的风险管理，通过制定系统化的风险管理程序，对风险管理的整个流程进行评估和改进。公司奉行分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，构建由四大防线共同筑成的风险管理体系：第一道防线由各个业务部门构成，各业务部门总监作为风险责任人；第二道监控防线由合规风控部构成，对公司运营过程中产生的或潜在的各项风险进行有效管理，并就内部控制及风险管理制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能；第三道防线是由总经理及其下设的风险管理委员会构成，总经理负责公司日常经营管理中的风险管理工作。总经理下设风险管理委员会，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；第四道监控防线由董事会及其下设公司风险控制委员会构成。董事会负责公司整体风险的预防和控制，审核、监督公司风险管理制度的有效执行。董事会下设公司风险控制委员会，协助董事会确立公司风险取向，风险总量、风险限额，制定和调整公司风险管理战略、原则、政策和指导方针，并确保其得到有效执行。

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，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于2026年6月30日，本基金无债券投资或资产支持证券投资(2025年12月31日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

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

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，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于2026年6月30日，本基金所承担的全部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，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

现价值。于2026年06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、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026年 06月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资	3,820,181.85	-	-	-	3,820,181.85

金					
结算备付金	1,026.84	-	-	-	1,026.84
交易性金融资产	-	-	-	57,363,912.13	57,363,912.13
应收申购款	-	-	-	15,815.18	15,815.18
资产总计	3,821,208.69	-	-	57,379,727.31	61,200,936.00
负债					
应付赎回款	-	-	-	338,160.07	338,160.07
应付管理人报酬	-	-	-	50,131.39	50,131.39
应付托管费	-	-	-	10,026.29	10,026.29
应付销售服务费	-	-	-	7,497.47	7,497.47
其他负债	-	-	-	51,945.95	51,945.95
负债总计	-	-	-	457,761.17	457,761.17
利率敏感度缺口	3,821,208.69	-	-	56,921,966.14	60,743,174.83
上年度末 2025年 12月31	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

日					
资产					
货币资金	6,341,385.35	-	-	-	6,341,385.35
结算备付金	1,023.18	-	-	-	1,023.18
交易性金融资产	-	-	-	63,945,610.64	63,945,610.64
应收申购款	-	-	-	188,940.46	188,940.46
资产总计	6,342,408.53	-	-	64,134,551.10	70,476,959.63
负债					
应付赎回款	-	-	-	527,271.44	527,271.44
应付管理人报酬	-	-	-	59,474.67	59,474.67
应付托管费	-	-	-	11,894.94	11,894.94
应付销售服务费	-	-	-	9,298.23	9,298.23
其他负债	-	-	-	100,002.68	100,002.68
负债总计	-	-	-	707,941.96	707,941.96
利率敏感度缺口	6,342,408.53	-	-	63,426,609.14	69,769,017.67

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2026年6月30日，本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资(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 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金为增强型股票指数基金，在严格控制对中证500指数跟踪误差的基础上，通过量化投资方式进行积极的组合管理和风险控制。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票资产投资比例不低于基金资产的80%；其中投资于中证500指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例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。股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	57,363,912.13	94.44	63,945,610.64	91.65
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—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	57,363,912.13	94.44	63,945,610.64	91.65

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证500指数以外的其他变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
	中证500指数上升5%	3,168,194.82	3,293,129.62
	中证500指数下降5%	-3,168,194.82	-3,293,129.62

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

- 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
- 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
- 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	56,264,757.13	62,480,210.64
第二层次	5,055.00	-
第三层次	1,094,100.00	1,465,400.00
合计	57,363,912.13	63,945,610.64

6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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(2025年12月31日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	57,363,912.13	93.73

	其中：股票	57,363,912.13	93.73
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	3,821,208.69	6.24
8	其他各项资产	15,815.18	0.03
9	合计	61,200,936.00	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	160,804.00	0.26
B	采矿业	1,528,471.30	2.52
C	制造业	37,563,566.23	61.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,075,233.00	1.77
E	建筑业	216,926.00	0.36
F	批发和零售业	706,600.00	1.16
G	交通运输、仓储和邮政业	454,170.00	0.75
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,537,391.92	5.82
J	金融业	2,186,150.00	3.60
K	房地产业	45,714.00	0.08

L	租赁和商务服务业	603,425.00	0.99
M	科学研究和技术服务业	333,719.88	0.55
N	水利、环境和公共设施管理业	326,991.20	0.54
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	106,046.00	0.17
R	文化、体育和娱乐业	115,264.00	0.19
S	综合	-	-
	合计	48,960,472.53	80.60

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	162,692.00	0.27
B	采矿业	160,600.00	0.26
C	制造业	5,588,514.40	9.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	393,373.00	0.65
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	524,250.00	0.86
G	交通运输、仓储和邮政业	600,614.00	0.99
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	220,360.00	0.36
J	金融业	425,242.00	0.70
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	165,654.20	0.27
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	162,140.00	0.27

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	8,403,439.60	13.83

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	688120	华海清科	3,039	979,105.02	1.61
2	300604	长川科技	2,000	682,840.00	1.12
3	688347	华虹宏力	2,000	672,600.00	1.11
4	300857	协创数据	1,900	645,810.00	1.06
5	300136	信维通信	5,000	596,250.00	0.98
6	002281	光迅科技	2,100	539,574.00	0.89
7	002008	大族激光	3,500	525,385.00	0.86
8	688361	中科飞测	1,200	516,000.00	0.85
9	300223	君正股份	2,000	497,800.00	0.82
10	688002	睿创微纳	3,115	481,859.35	0.79
11	688220	翱捷科技	3,700	459,984.00	0.76
12	002436	兴森科技	8,400	427,980.00	0.70
13	300054	鼎龙股份	3,800	402,686.00	0.66
14	300285	国瓷材料	3,900	402,402.00	0.66
15	002738	中矿资源	6,600	389,334.00	0.64

16	300390	天华新能	4,100	383,391.00	0.63
17	001309	德明利	400	377,160.00	0.62
18	300757	罗博特科	600	371,400.00	0.61
19	600105	永鼎股份	5,500	371,140.00	0.61
20	300666	江丰电子	1,000	368,600.00	0.61
21	688777	中控技术	3,000	352,500.00	0.58
22	300037	新宙邦	3,700	343,545.00	0.57
23	002409	雅克科技	1,400	314,300.00	0.52
24	301358	湖南裕能	4,100	311,067.00	0.51
25	688037	芯源微	700	307,335.00	0.51
26	300548	长芯博创	1,100	305,800.00	0.50
27	600879	航天电子	14,100	300,189.00	0.49
28	300346	南大光电	3,200	296,480.00	0.49
29	688017	绿的谐波	700	292,502.00	0.48
30	300058	蓝色光标	21,200	291,712.00	0.48
31	000021	深科技	4,200	269,934.00	0.44
32	002851	麦格米特	1,600	267,488.00	0.44
33	300395	菲利华	2,000	267,460.00	0.44
34	600988	赤峰黄金	10,100	265,832.00	0.44
35	688019	安集科技	780	264,778.80	0.44
36	688313	仕佳光子	1,400	258,510.00	0.43
37	300567	精测电子	800	254,080.00	0.42
38	301526	国际复材	5,400	252,018.00	0.41
39	600498	烽火通信	3,400	250,240.00	0.41
40	002185	华天科技	11,200	249,872.00	0.41
41	002850	科达利	1,300	246,090.00	0.41
42	688469	芯联集成	22,750	241,377.50	0.40
43	300475	香农芯创	800	240,000.00	0.40
44	688099	晶晨股份	2,382	238,747.80	0.39
45	688702	盛科通信	600	233,994.00	0.39
46	002138	顺络电子	3,200	233,920.00	0.39

47	300751	迈为股份	800	225,968.00	0.37
48	300373	扬杰科技	1,400	220,122.00	0.36
49	603256	宏和科技	800	212,264.00	0.35
50	600141	兴发集团	4,400	206,668.00	0.34
51	688027	国盾量子	400	201,604.00	0.33
52	000703	恒逸石化	14,800	200,836.00	0.33
53	688172	燕东微	2,395	200,365.70	0.33
54	601233	桐昆股份	9,200	199,180.00	0.33
55	301611	珂玛科技	1,100	198,077.00	0.33
56	605589	圣泉集团	3,100	197,067.00	0.32
57	600378	昊华科技	2,600	195,988.00	0.32
58	600292	电投水电	16,200	195,048.00	0.32
59	002340	格林美	29,500	194,995.00	0.32
60	600392	盛和资源	6,500	193,505.00	0.32
61	002273	水晶光电	5,400	191,592.00	0.32
62	001389	广合科技	800	189,800.00	0.31
63	300620	光库科技	500	189,100.00	0.31
64	000960	锡业股份	4,400	187,836.00	0.31
65	688629	华丰科技	1,000	187,510.00	0.31
66	605358	立昂微	2,400	186,240.00	0.31
67	002126	银轮股份	3,700	184,260.00	0.30
68	600885	宏发股份	5,300	182,797.00	0.30
69	002195	岩山科技	27,800	181,812.00	0.30
70	603049	中策橡胶	4,000	179,240.00	0.30
71	688234	天岳先进	1,033	179,235.83	0.30
72	300017	网宿科技	13,600	176,936.00	0.29
73	600497	驰宏锌锗	14,600	176,806.00	0.29
74	002407	多氟多	3,500	175,805.00	0.29
75	300972	万辰集团	1,000	173,410.00	0.29
76	300339	润和软件	4,500	173,295.00	0.29
77	688052	纳芯微	600	172,986.00	0.28

78	300570	太辰光	700	172,697.00	0.28
79	601179	中国西电	11,500	171,580.00	0.28
80	002131	利欧股份	35,700	169,575.00	0.28
81	300458	全志科技	4,280	168,888.80	0.28
82	000831	中国稀土	3,000	166,470.00	0.27
83	601869	长飞光纤	300	163,770.00	0.27
84	600711	盛屯矿业	14,700	161,259.00	0.27
85	000783	长江证券	15,800	154,050.00	0.25
86	002812	恩捷股份	2,300	153,893.00	0.25
87	600143	金发科技	9,800	151,410.00	0.25
88	600909	华安证券	13,600	151,096.00	0.25
89	688411	海博思创	500	145,600.00	0.24
90	003031	中瓷电子	800	144,240.00	0.24
91	600157	永泰能源	89,000	143,290.00	0.24
92	002261	拓维信息	5,100	142,851.00	0.24
93	600352	浙江龙盛	11,700	141,687.00	0.23
94	002797	第一创业	21,300	139,941.00	0.23
95	300759	康龙化成	4,800	138,864.00	0.23
96	600601	方正科技	10,000	138,400.00	0.23
97	601555	东吴证券	17,000	134,640.00	0.22
98	603659	璞泰来	4,600	133,078.00	0.22
99	688213	思特威	1,238	132,552.66	0.22
100	688578	艾力斯	1,200	131,040.00	0.22
101	002203	海亮股份	5,700	130,245.00	0.21
102	600021	上海电力	8,600	129,602.00	0.21
103	002821	凯莱英	800	129,600.00	0.21
104	601991	大唐发电	18,300	129,564.00	0.21
105	301536	星宸科技	1,000	128,710.00	0.21
106	002472	双环传动	3,100	128,681.00	0.21
107	300001	特锐德	3,400	128,622.00	0.21
108	002601	龙佰集团	7,800	128,544.00	0.21

109	603129	春风动力	500	127,900.00	0.21
110	601198	东兴证券	9,400	127,746.00	0.21
111	300207	欣旺达	6,700	127,233.00	0.21
112	688387	信科移动	6,400	126,976.00	0.21
113	603308	应流股份	2,100	126,840.00	0.21
114	688122	西部超导	2,000	125,620.00	0.21
115	300115	长盈精密	4,400	122,936.00	0.20
116	002517	恺英网络	7,500	121,875.00	0.20
117	601108	财通证券	13,800	119,370.00	0.20
118	688301	奕瑞科技	960	119,040.00	0.20
119	601162	天风证券	35,300	118,961.00	0.20
120	002465	海格通信	9,300	118,761.00	0.20
121	688676	金盘科技	1,400	118,496.00	0.20
122	688322	奥比中光	900	117,495.00	0.19
123	300496	中科创达	1,900	117,401.00	0.19
124	601099	太平洋	34,700	116,939.00	0.19
125	002056	横店东磁	3,800	115,824.00	0.19
126	300142	沃森生物	8,900	115,611.00	0.19
127	300454	深信服	1,200	115,440.00	0.19
128	600563	法拉电子	600	114,480.00	0.19
129	002429	兆驰股份	11,000	114,290.00	0.19
130	688385	复旦微电	1,600	114,064.00	0.19
131	002432	九安医疗	1,600	113,088.00	0.19
132	300724	捷佳伟创	1,600	112,960.00	0.19
133	603156	养元饮品	2,300	112,861.00	0.19
134	002414	高德红外	8,500	112,710.00	0.19
135	600109	国金证券	12,800	112,384.00	0.19
136	002130	沃尔核材	5,900	111,864.00	0.18
137	689009	九号公司	2,869	109,452.35	0.18
138	301200	大族数控	300	108,195.00	0.18
139	603650	彤程新材	1,100	107,778.00	0.18

140	300073	当升科技	2,200	105,688.00	0.17
141	002155	湖南黄金	4,390	104,789.30	0.17
142	600699	均胜电子	4,800	103,728.00	0.17
143	300474	景嘉微	1,700	102,816.00	0.17
144	000893	亚钾国际	2,500	102,225.00	0.17
145	300383	光环新网	8,200	102,008.00	0.17
146	000733	振华科技	1,800	101,952.00	0.17
147	688235	百济神州	398	101,334.78	0.17
148	601958	金钼股份	3,600	101,196.00	0.17
149	300919	中伟新材	2,300	100,625.00	0.17
150	603179	新泉股份	2,020	100,293.00	0.17
151	300012	华测检测	7,200	99,792.00	0.16
152	600256	广汇能源	20,200	99,788.00	0.16
153	300623	捷捷微电	2,200	98,978.00	0.16
154	603379	三美股份	1,300	98,657.00	0.16
155	300432	富临精工	4,900	98,441.00	0.16
156	600884	杉杉股份	7,200	97,560.00	0.16
157	002444	巨星科技	3,100	96,410.00	0.16
158	603225	新凤鸣	4,900	96,285.00	0.16
159	603920	世运电路	2,000	96,080.00	0.16
160	300003	乐普医疗	8,100	95,985.00	0.16
161	002402	和而泰	3,700	95,571.00	0.16
162	000728	国元证券	12,700	95,123.00	0.16
163	688065	凯赛生物	1,984	94,934.40	0.16
164	000034	神州数码	3,420	94,905.00	0.16
165	601615	明阳智能	8,200	94,874.00	0.16
166	600060	海信视像	3,400	94,758.00	0.16
167	600707	彩虹股份	5,600	94,584.00	0.16
168	300677	英科医疗	2,400	94,008.00	0.15
169	688375	国博电子	900	93,870.00	0.15
170	000060	中金岭南	12,400	93,868.00	0.15

171	300953	震裕科技	700	93,590.00	0.15
172	688266	泽璟制药	800	93,328.00	0.15
173	002673	西部证券	14,300	92,807.00	0.15
174	002487	大金重工	1,600	92,752.00	0.15
175	300748	金力永磁	3,000	92,550.00	0.15
176	002335	科华数据	2,175	92,328.75	0.15
177	002157	正邦科技	32,800	92,168.00	0.15
178	300699	光威复材	3,200	91,680.00	0.15
179	688331	荣昌生物	700	91,182.00	0.15
180	601696	中银证券	7,200	91,080.00	0.15
181	603688	石英股份	1,100	90,871.00	0.15
182	300024	机器人	4,700	90,851.00	0.15
183	603087	甘李药业	1,600	90,816.00	0.15
184	000878	云南铜业	5,700	90,516.00	0.15
185	000559	万向钱潮	7,000	90,510.00	0.15
186	600801	华新建材	5,800	90,480.00	0.15
187	688728	格科微	4,269	89,819.76	0.15
188	600521	华海药业	6,100	87,840.00	0.14
189	000750	国海证券	23,600	86,848.00	0.14
190	002085	万丰奥威	7,800	86,502.00	0.14
191	603160	汇顶科技	1,400	86,394.00	0.14
192	601212	白银有色	17,000	86,360.00	0.14
193	000967	盈峰环境	8,200	86,346.00	0.14
194	603119	浙江荣泰	1,300	86,242.00	0.14
195	688599	天合光能	6,100	86,132.00	0.14
196	002756	永兴材料	1,500	84,960.00	0.14
197	600637	东方明珠	10,200	84,762.00	0.14
198	603606	东方电缆	2,040	84,680.40	0.14
199	601699	潞安环能	5,900	84,252.00	0.14
200	000415	渤海租赁	20,700	84,249.00	0.14
201	603806	福斯特	5,000	83,950.00	0.14

202	002025	航天电器	1,100	83,842.00	0.14
203	688608	恒玄科技	500	83,595.00	0.14
204	002064	华峰化学	8,800	83,512.00	0.14
205	000623	吉林敖东	4,700	83,331.00	0.14
206	600298	安琪酵母	2,300	83,260.00	0.14
207	600862	中航高科	4,600	82,938.00	0.14
208	002065	东华软件	11,600	82,824.00	0.14
209	603979	金诚信	1,400	82,642.00	0.14
210	688343	云天励飞	1,000	81,660.00	0.13
211	300763	锦浪科技	900	81,315.00	0.13
212	002271	东方雨虹	6,800	80,716.00	0.13
213	688772	珠海冠宇	4,105	80,581.15	0.13
214	000830	鲁西化工	6,700	80,400.00	0.13
215	002120	韵达股份	12,600	80,136.00	0.13
216	000661	长春高新	1,200	79,920.00	0.13
217	688615	合合信息	700	79,170.00	0.13
218	600737	中粮糖业	6,400	78,912.00	0.13
219	300679	电连技术	1,300	77,987.00	0.13
220	000786	北新建材	4,300	77,787.00	0.13
221	688018	乐鑫科技	603	77,135.76	0.13
222	603596	伯特利	3,100	77,004.00	0.13
223	600369	西南证券	19,100	76,782.00	0.13
224	000983	山西焦煤	13,200	76,560.00	0.13
225	300002	神州泰岳	9,800	76,538.00	0.13
226	300487	蓝晓科技	1,300	76,505.00	0.13
227	603290	斯达半导	500	76,470.00	0.13
228	600499	科达制造	5,500	75,900.00	0.12
229	688188	柏楚电子	711	75,863.70	0.12
230	603077	和邦生物	32,600	75,632.00	0.12
231	000683	博源化工	13,000	74,880.00	0.12
232	688568	中科星图	1,800	74,646.00	0.12

233	002739	儒意电影	7,700	73,920.00	0.12
234	600765	中航重机	5,700	73,644.00	0.12
235	600166	福田汽车	25,300	73,623.00	0.12
236	600171	上海贝岭	2,300	73,462.00	0.12
237	002410	广联达	9,000	73,440.00	0.12
238	000887	中鼎股份	4,100	73,349.00	0.12
239	688692	达梦数据	300	73,287.00	0.12
240	000155	川能动力	6,100	73,078.00	0.12
241	001696	宗申动力	3,500	72,835.00	0.12
242	603345	安井食品	900	72,171.00	0.12
243	600901	江苏金租	12,540	72,105.00	0.12
244	603605	珀莱雅	1,200	71,904.00	0.12
245	603444	吉比特	200	71,684.00	0.12
246	000519	中兵红箭	3,400	71,638.00	0.12
247	002266	浙富控股	14,100	71,346.00	0.12
248	000738	航发控制	3,900	71,331.00	0.12
249	300627	华测导航	2,500	71,000.00	0.12
250	000039	中集集团	8,700	70,557.00	0.12
251	603766	隆鑫通用	5,900	70,387.00	0.12
252	600536	中国软件	2,500	70,300.00	0.12
253	002683	广东宏大	2,400	70,296.00	0.12
254	600985	淮北矿业	5,000	70,250.00	0.12
255	002624	完美世界	5,600	69,552.00	0.11
256	601016	节能风电	17,800	69,064.00	0.11
257	000423	东阿阿胶	1,500	68,040.00	0.11
258	688297	中无人机	1,636	67,975.80	0.11
259	000528	柳工	9,000	67,950.00	0.11
260	600100	同方股份	9,900	67,815.00	0.11
261	688538	和辉光电	25,965	67,509.00	0.11
262	000050	深天马 A	6,800	67,388.00	0.11
263	000400	许继电气	3,100	67,270.00	0.11

264	000987	越秀资本	8,600	67,252.00	0.11
265	000729	燕京啤酒	6,600	66,858.00	0.11
266	601216	君正集团	14,800	66,008.00	0.11
267	603699	纽威股份	1,300	65,390.00	0.11
267	002044	美年健康	13,000	65,390.00	0.11
268	600312	平高电气	3,700	65,342.00	0.11
269	300558	贝达药业	1,000	65,070.00	0.11
270	600348	华阳股份	8,500	65,025.00	0.11
271	002430	杭氧股份	2,100	65,016.00	0.11
272	688582	芯动联科	1,000	65,000.00	0.11
273	603816	顾家家居	2,900	64,844.00	0.11
274	600863	华能蒙电	13,700	64,390.00	0.11
275	688180	君实生物	1,900	64,258.00	0.11
276	601717	中创智领	4,600	63,986.00	0.11
277	601799	星宇股份	700	63,434.00	0.10
278	601990	南京证券	9,500	62,415.00	0.10
279	600583	海油工程	12,400	62,372.00	0.10
280	600642	申能股份	7,100	61,983.00	0.10
281	688187	时代电气	900	61,794.00	0.10
282	300888	稳健医疗	2,200	61,578.00	0.10
283	002603	以岭药业	4,100	61,500.00	0.10
284	600390	五矿资本	13,400	61,104.00	0.10
285	600685	中船防务	2,400	61,056.00	0.10
286	301606	绿联科技	1,000	61,020.00	0.10
287	603486	科沃斯	1,200	60,900.00	0.10
288	600486	扬农化工	1,200	60,840.00	0.10
289	603885	吉祥航空	5,900	60,711.00	0.10
290	603568	伟明环保	3,940	60,597.20	0.10
291	000032	深桑达 A	2,400	59,880.00	0.10
292	603298	杭叉集团	2,500	59,650.00	0.10
293	600595	中孚实业	10,600	59,572.00	0.10

294	601001	晋控煤业	3,400	59,126.00	0.10
295	600316	洪都航空	2,100	58,674.00	0.10
296	600153	建发股份	7,300	57,889.00	0.10
297	002939	长城证券	6,900	57,546.00	0.09
298	603939	益丰药房	3,200	57,536.00	0.09
299	688278	特宝生物	1,057	57,500.80	0.09
300	600562	国睿科技	2,700	57,294.00	0.09
301	601106	中国一重	17,300	57,090.00	0.09
302	601399	国机重装	16,100	56,350.00	0.09
303	002152	广电运通	6,000	56,280.00	0.09
304	688281	华秦科技	1,120	56,257.60	0.09
305	000591	太阳能	12,200	56,120.00	0.09
306	002007	华兰生物	4,600	56,074.00	0.09
307	002926	华西证券	6,800	55,556.00	0.09
308	002841	视源股份	1,600	55,248.00	0.09
309	603728	鸣志电器	900	54,828.00	0.09
310	000582	北部湾港	5,100	54,723.00	0.09
311	600602	云赛智联	3,400	54,672.00	0.09
312	600380	健康元	5,800	54,636.00	0.09
313	688295	中复神鹰	900	54,486.00	0.09
314	688617	惠泰医疗	300	54,468.00	0.09
315	001203	大中矿业	1,800	53,910.00	0.09
316	002223	鱼跃医疗	2,100	53,886.00	0.09
317	603000	人民网	3,600	53,244.00	0.09
318	688248	南网科技	766	52,991.88	0.09
319	600873	梅花生物	7,200	52,920.00	0.09
320	600995	南网储能	4,300	52,890.00	0.09
320	600578	京能电力	8,200	52,890.00	0.09
321	000951	中国重汽	2,700	52,677.00	0.09
322	600008	首创环保	19,300	52,496.00	0.09
323	688114	华大智造	1,027	52,459.16	0.09

324	000997	新大陆	3,200	52,160.00	0.09
325	002831	裕同科技	1,463	52,024.28	0.09
326	000921	海信家电	1,900	51,908.00	0.09
327	002299	圣农发展	3,400	51,544.00	0.08
328	601866	中远海发	23,200	51,272.00	0.08
329	603338	浙江鼎力	1,200	51,000.00	0.08
330	000723	美锦能源	15,100	50,585.00	0.08
331	688318	财富趋势	700	49,917.00	0.08
332	600816	建元信托	20,100	49,044.00	0.08
333	688778	厦钨新能	900	48,960.00	0.08
334	000739	普洛药业	2,900	48,314.00	0.08
335	600435	北方导航	4,300	48,160.00	0.08
336	600332	白云山	2,400	48,096.00	0.08
337	300100	双林股份	1,700	47,226.00	0.08
338	600546	山煤国际	4,300	46,999.00	0.08
339	600820	隧道股份	9,000	46,890.00	0.08
340	000932	华菱钢铁	13,500	46,845.00	0.08
341	002312	川发龙蟒	5,100	46,767.00	0.08
342	603341	龙旗科技	1,100	46,739.00	0.08
343	600363	联创光电	1,300	46,514.00	0.08
344	600095	湘财股份	6,100	45,933.00	0.08
345	000598	兴蓉环境	7,100	45,582.00	0.08
346	600038	中直股份	1,800	45,522.00	0.07
347	688166	博瑞医药	1,300	45,513.00	0.07
348	300735	光弘科技	2,000	45,480.00	0.07
349	002318	久立特材	1,900	45,410.00	0.07
350	603899	晨光股份	2,200	45,386.00	0.07
351	601608	中信重工	9,500	45,315.00	0.07
352	601666	平煤股份	6,300	45,045.00	0.07
353	002078	太阳纸业	3,600	44,964.00	0.07
354	601567	三星电气	3,000	44,820.00	0.07

355	601880	辽港股份	32,200	44,436.00	0.07
356	601000	唐山港	10,700	44,405.00	0.07
357	600704	物产中大	9,400	44,368.00	0.07
358	601598	中国外运	8,700	43,152.00	0.07
359	600177	雅戈尔	5,700	42,921.00	0.07
360	600871	石化油服	21,100	42,833.00	0.07
361	300676	华大基因	1,200	42,072.00	0.07
362	600511	国药股份	1,600	41,664.00	0.07
363	600517	国网英大	8,900	41,652.00	0.07
364	601236	红塔证券	6,100	41,602.00	0.07
365	003022	联泓新科	1,600	41,440.00	0.07
366	600977	中国电影	3,200	41,344.00	0.07
367	600132	重庆啤酒	1,000	41,300.00	0.07
368	600967	内蒙一机	3,800	41,230.00	0.07
369	600329	达仁堂	1,100	40,942.00	0.07
370	002773	康弘药业	2,000	40,900.00	0.07
371	600131	国网信通	2,800	40,880.00	0.07
372	600763	通策医疗	1,200	40,656.00	0.07
373	002568	百润股份	2,400	40,608.00	0.07
374	002984	森麒麟	3,100	40,517.00	0.07
375	000027	深圳能源	6,500	40,300.00	0.07
376	000737	北方铜业	3,000	39,660.00	0.07
377	002262	恩华药业	2,100	39,375.00	0.06
378	600516	方大炭素	6,300	38,871.00	0.06
379	600483	福能股份	3,800	38,722.00	0.06
380	600970	中材国际	5,400	38,502.00	0.06
381	002583	海能达	5,000	38,450.00	0.06
382	603565	中谷物流	3,900	38,259.00	0.06
383	000062	深圳华强	1,200	38,184.00	0.06
384	601611	中国核建	3,400	37,910.00	0.06
385	601865	福莱特	3,600	37,836.00	0.06

386	600282	南钢股份	8,200	37,638.00	0.06
387	601156	东航物流	2,300	37,076.00	0.06
388	000629	钒钛股份	11,100	37,074.00	0.06
389	600535	天士力	2,800	37,044.00	0.06
390	300718	长盛轴承	600	36,582.00	0.06
391	600968	海油发展	10,900	36,297.00	0.06
392	002244	滨江集团	4,600	34,960.00	0.06
393	600598	北大荒	3,200	34,688.00	0.06
394	000513	丽珠集团	1,200	34,668.00	0.06
395	300957	贝泰妮	1,100	34,661.00	0.06
396	000883	湖北能源	8,000	34,560.00	0.06
397	601118	海南橡胶	6,900	33,948.00	0.06
398	600170	上海建工	15,200	33,744.00	0.06
399	300146	汤臣倍健	3,700	33,448.00	0.06
400	002153	石基信息	4,600	33,258.00	0.05
401	600582	天地科技	7,400	32,930.00	0.05
402	603589	口子窖	1,700	31,756.00	0.05
403	000709	河钢股份	16,300	31,622.00	0.05
404	600566	济川药业	1,400	31,066.00	0.05
405	000537	绿发电力	4,200	30,702.00	0.05
406	601966	玲珑轮胎	3,000	30,570.00	0.05
407	000800	一汽解放	4,000	23,800.00	0.04
408	603233	大参林	1,100	16,533.00	0.03
409	600906	财达证券	1,900	14,174.00	0.02
410	600208	衢州发展	3,800	10,754.00	0.02

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	301308	江波龙	1,100	745,900.00	1.23
2	600487	亨通光电	3,000	328,020.00	0.54
3	688409	富创精密	1,000	306,250.00	0.50
4	688525	佰维存储	400	197,892.00	0.33
5	600549	厦门钨业	2,300	195,960.00	0.32
6	688155	先惠技术	2,200	177,958.00	0.29
7	301275	汉朔科技	3,900	175,110.00	0.29
8	001298	好上好	8,400	174,300.00	0.29
9	002837	英维克	2,160	171,849.60	0.28
10	301662	宏工科技	1,650	167,178.00	0.28
11	603066	音飞储存	17,100	166,896.00	0.27
12	301500	飞南资源	6,400	166,720.00	0.27
13	301048	金鹰重工	19,300	166,173.00	0.27
14	300226	上海钢联	10,820	165,654.20	0.27
15	601218	吉鑫科技	38,500	165,550.00	0.27
16	003010	若羽臣	6,800	165,240.00	0.27
17	600787	中储股份	39,500	165,110.00	0.27
18	603507	振江股份	5,000	164,450.00	0.27
19	300970	华绿生物	8,900	162,692.00	0.27
20	601033	永兴股份	12,100	162,140.00	0.27
21	601398	工商银行	22,900	161,903.00	0.27
22	301345	涛涛车业	700	161,700.00	0.27
23	601069	西部黄金	7,300	160,600.00	0.26
24	605305	中际联合	3,700	155,104.00	0.26
25	300428	立中集团	8,300	150,894.00	0.25
26	000421	南京公用	30,000	148,800.00	0.24
27	002204	大连重工	28,100	148,368.00	0.24
28	688147	微导纳米	1,000	147,020.00	0.24
29	601288	农业银行	24,000	145,680.00	0.24
30	301026	浩通科技	7,140	144,370.80	0.24
31	002345	潮宏基	15,400	141,218.00	0.23

32	601107	四川成渝	28,100	137,128.00	0.23
33	000657	中钨高新	1,400	134,008.00	0.22
34	600768	宁波富邦	8,900	133,322.00	0.22
35	002215	诺普信	16,000	131,680.00	0.22
36	000900	现代投资	38,000	131,480.00	0.22
37	603025	大豪科技	9,100	124,124.00	0.20
38	002588	史丹利	15,700	124,030.00	0.20
39	002353	杰瑞股份	800	122,000.00	0.20
40	605599	菜百股份	8,700	119,190.00	0.20
41	002043	兔宝宝	10,700	118,556.00	0.20
42	000905	厦门港务	15,200	117,952.00	0.19
43	000899	赣能股份	11,800	113,988.00	0.19
44	600710	苏美达	11,800	112,808.00	0.19
45	002479	富春环保	26,200	110,302.00	0.18
46	600118	中国卫星	1,000	82,050.00	0.14
47	300450	先导智能	1,900	77,368.00	0.13
48	300900	广联航空	2,000	72,120.00	0.12
49	601988	中国银行	10,300	58,916.00	0.10
50	601939	建设银行	6,100	58,743.00	0.10
51	002558	巨人网络	2,000	55,120.00	0.09
52	688183	生益电子	400	52,960.00	0.09
53	002202	金风科技	1,900	45,410.00	0.07
54	002080	中材科技	500	45,000.00	0.07
55	301507	民生健康	3,600	43,308.00	0.07
56	002054	德美化工	6,000	39,900.00	0.07
57	300750	宁德时代	100	39,301.00	0.06
58	000958	电投产融	2,700	15,228.00	0.03
59	002440	闰土股份	1,200	12,300.00	0.02
60	301031	中熔电气	80	9,556.00	0.02
61	001248	华润新能源	500	5,055.00	0.01
62	301219	腾远钴业	70	3,836.00	0.01

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	688347	华虹宏力	653,173.50	0.94
2	688099	晶晨股份	525,347.80	0.75
3	300136	信维通信	494,547.00	0.71
4	300058	蓝色光标	493,878.00	0.71
5	300697	电工合金	432,941.00	0.62
6	300857	协创数据	399,131.00	0.57
7	600118	中国卫星	395,499.00	0.57
8	002558	巨人网络	389,622.00	0.56
9	600580	卧龙电驱	385,671.00	0.55
10	601033	永兴股份	385,388.00	0.55
11	600105	永鼎股份	384,540.00	0.55
12	600879	航天电子	382,673.00	0.55
13	603025	大豪科技	380,512.00	0.55
14	002131	利欧股份	375,249.00	0.54
15	000155	川能动力	363,952.00	0.52
16	300666	江丰电子	356,068.00	0.51
17	301345	涛涛车业	345,750.00	0.50
18	001309	德明利	345,060.00	0.49
19	002768	国恩股份	340,847.00	0.49
20	688525	佰维存储	328,122.00	0.47

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

7.4.2 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	300012	华测检测	1,154,285.00	1.65
2	688525	佰维存储	1,100,257.59	1.58
3	301200	大族数控	1,046,644.00	1.50
4	600487	亨通光电	999,331.00	1.43
5	600801	华新建材	986,238.00	1.41
6	600549	厦门钨业	947,630.00	1.36
7	300476	胜宏科技	874,479.00	1.25
8	603233	大参林	781,914.00	1.12
9	301308	江波龙	762,711.00	1.09
10	688281	华秦科技	702,410.18	1.01
11	688072	拓荆科技	685,090.00	0.98
12	688521	芯原股份	667,238.00	0.96
13	603486	科沃斯	640,741.00	0.92
14	603379	三美股份	630,721.00	0.90
15	002156	通富微电	623,335.00	0.89
16	688819	天能股份	606,447.19	0.87
17	603699	纽威股份	569,547.00	0.82
18	002353	杰瑞股份	561,553.00	0.80
19	688099	晶晨股份	533,175.13	0.76
20	600578	京能电力	532,131.00	0.76

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

7.4.3 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	58,314,487.66
卖出股票收入（成交）总额	76,302,998.67

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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

7.12.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	15,815.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,815.18

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	301308	江波龙	675,520.00	1.11	询价转让限售

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，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

份额 级别	持 有	户均持有的 基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	人 户 数 (户)		持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
汇安 中证5 00增 强A	1,1 41	25,729.56	5,171,700.71	17.6 2%	24,185,726.12	82.38%
汇安 中证5 00增 强C	3,1 63	4,801.92	0.00	0.00%	15,188,466.87	100.00%
合计	4,2 54	10,471.53	5,171,700.71	11.6 1%	39,374,192.99	88.39%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比 例
基金管理人所有从业人员持有本基金	汇安中证500增强A	23,214.60	0.0791%
	汇安中证500增强C	89.00	0.0006%
	合计	23,303.60	0.0523%

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	汇安中证500增强A	0
	汇安中证500增强C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基 金	汇安中证500增强A	0~10
	汇安中证500增强C	0
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	汇安中证500增强A	汇安中证500增强C
基金合同生效日(2020年11月16日)基金份额总额	369,250,181.79	187,727,089.46
本报告期期初基金份额总额	36,658,637.83	24,030,651.67
本报告期基金总申购份额	3,234,245.94	11,534,935.57
减：本报告期基金总赎回份额	10,535,456.94	20,377,120.37
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	29,357,426.83	15,188,466.87

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金在报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

本报告期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事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金在报告期内基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自2024年9月14日至本报告期末聘任容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本报告期内未发生变动。

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，本基金管理人未受到调查或处罚。

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未受到调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

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，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

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	
万联证券	2	134,123,221.33	100.00%	24,935.52	100.00%	-

注：

- (1) 基金管理人负责选择证券经纪商，使用其经纪服务席位作为本基金的交易单元。基金证券经纪商选择标准如下：
- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
 - 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施稳定、响应支持及时、能满足公募基金采用券商交易模式进行证券交易和结算的需要；
 - 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等四个方面。
- (2) 基金交易单元的选择程序如下：
- 1) 本基金管理人根据上述标准测试并考察后确定选用交易单元的证券经营机构；
 - 2) 本基金管理人和被选中的证券经营机构签订证券经纪服务协议。

(3) 交易单元变更情况

本基金本报告期内无交易单元变更。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
万联证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	汇安中证500指数增强型证券投资基金2025年第4季度报告	规定报刊和/或公司网站	2026-01-22
2	汇安基金管理有限责任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）	规定报刊和/或公司网站	2026-03-31
3	汇安中证500指数增强型证券投资基金2025年年度报告	规定报刊和/或公司网站	2026-03-31
4	汇安基金管理有限责任公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件及其他身份基本信息的公告	规定报刊和/或公司网站	2026-04-03
5	汇安中证500指数增强型证券投资基金2026年第1季度报告	规定报刊和/或公司网站	2026-04-22
6	汇安基金管理有限责任公司	规定报刊和/或公司网站	2026-04-22

	关于浙江分公司成立的公告		
7	汇安基金管理有限责任公司 关于旗下部分基金在直销渠道开展费率优惠活动的公告	规定报刊和/或公司网站	2026-06-30

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内未存在单一基金份额持有人持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准汇安中证500指数增强型证券投资基金募集的文件
- (2) 《汇安中证500指数增强型证券投资基金基金合同》
- (3) 《汇安中证500指数增强型证券投资基金招募说明书》
- (4) 《汇安中证500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
- (6) 报告期内在规定报刊及规定网站上披露的各项公告
- (7) 中国证监会规定的其他文件

12.2 存放地点

北京市东城区东直门南大街5号中青旅大厦13层
上海市虹口区东大名路501白玉兰大厦36层

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所及网站免费查阅备查文件，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人汇安基金管理有限责任公司，客户服务中心电话010-56711690。

公司网站：<http://www.huianfund.cn>

汇安基金管理有限责任公司
二〇二六年八月三十一日