圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金

2024年中期报告

2024年06月30日

基金管理人:圆信永丰基金管理有限公司

基金托管人:国泰君安证券股份有限公司

送出日期:2024年08月30日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年8月29日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年1月1日起至2024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 7
§3 主要财务指标和基金净值表现 7
3.1 主要会计数据和财务指标 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遵规守信情况的说明 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 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 12
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 12
§5 托管人报告 13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 13
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 13
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 13
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 13
6.1 资产负债表 13
6.2 利润表 15
6.3 净资产变动表 17
6.4 报表附注 19
§7 投资组合报告 44
7.1 期末基金资产组合情况 44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 45
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 47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 61
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 61
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 61
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 62
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 62
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 62
7.12 投资组合报告附注 62
§8 基金份额持有人信息 63

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 63
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 64
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 64
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 65
§9 开放式基金份额变动 65
§10 重大事件揭示 65
10.1 基金份额持有人大会决议 66
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 66
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 66
10.4 基金投资策略的改变 66
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 66
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 66
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 66
10.8 其他重大事件 67
§11 影响投资者决策的其他重要信息 68
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 68
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 68
§12 备查文件目录 68
12.1 备查文件目录 68
12.2 存放地点 69
12.3 查阅方式 69

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	圆信永丰中证500指数增强发起	
基金主代码	013878	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年12月01日	
基金管理人	圆信永丰基金管理有限公司	
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	83,538,500.80份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	圆信永丰中证500指数增强发起A	圆信永丰中证500指数增强发起C
下属分级基金的交易代码	013878	013879
报告期末下属分级基金的份额总额	78,537,584.15份	5,000,916.65份

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，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制，力争获取高于标的指数的投资收益。
投资策略	本基金为增强型指数基金，在力求有效跟踪标的指数，控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年跟踪误差不超过7.75%的基础上，结合量化方法追求超越标的指数的业绩水平。本基金的投资策略包括股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生产品投资策略、参与融资与转融通证券出借业务投资策略。
业绩比较基准	中证500指数收益率×95%＋同期银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型证券投资基金，其预期收益及预

	期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金将投资香港联合交易所上市的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。

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		圆信永丰基金管理有限公司	国泰君安证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	兰文伟	帅芳
	联系电话	021-60366000	021-38031815
	电子邮箱	service@gtsfund.com.cn	tgrxp@tg.gtja.com
客户服务电话		4006070088	021-38917599-5
传真		021-60366001	021-38677819
注册地址		中国（福建）自由贸易试验区厦门片区（保税港区）海景南二路45号4楼402单元之175	中国（上海）自由贸易试验区商城路618号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道1528号陆家嘴基金大厦19楼	上海市静安区新闸路669号博华广场19楼
邮政编码		200122	200041
法定代表人		胡荣炜	朱健

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.gtsfund.com.cn
基金中期报告备置地	上海市浦东新区世纪大道1528号陆家嘴基金大厦19楼

点	

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	圆信永丰基金管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道1528号陆家嘴基金大厦19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(2024年01月01日-2024年06月30日)	
	圆信永丰中证500指数增强发起A	圆信永丰中证500指数增强发起C
本期已实现收益	-542,206.12	-30,125.05
本期利润	-2,802,960.39	-181,909.31
加权平均基金份额本期利润	-0.0337	-0.0364
本期加权平均净值利润率	-4.44%	-4.82%
本期基金份额净值增长率	-4.62%	-4.77%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年06月30日)	
期末可供分配利润	-20,994,028.14	-1,365,083.72
期末可供分配基金份额利润	-0.2673	-0.2730
期末基金资产净值	57,543,556.01	3,635,832.93
期末基金份额净值	0.7327	0.7270
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-26.73%	-27.30%

注1：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用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。

注2：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的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。
注3：上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 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

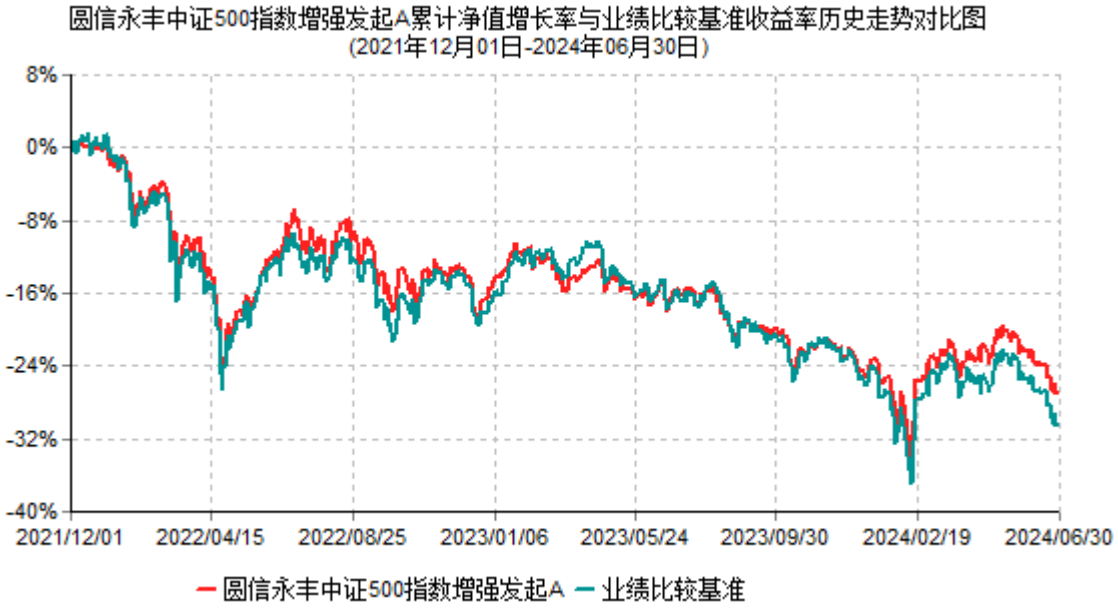
圆信永丰中证500指数增强发起A

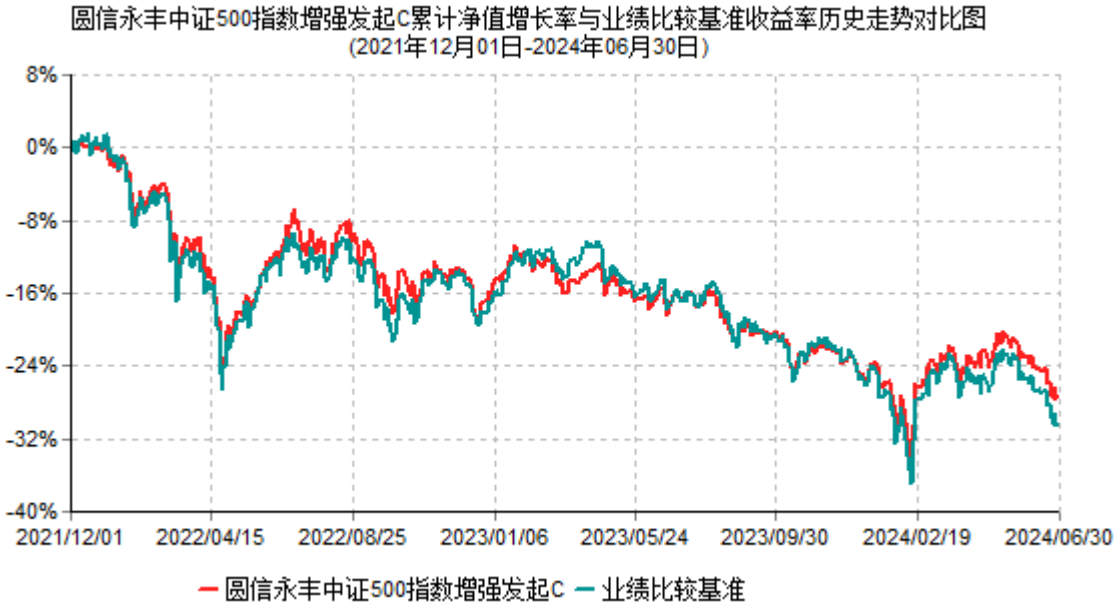
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-5.62%	0.90%	-6.55%	0.91%	0.93%	-0.01%
过去三个月	-4.12%	0.98%	-6.16%	1.09%	2.04%	-0.11%
过去六个月	-4.62%	1.41%	-8.46%	1.53%	3.84%	-0.12%
过去一年	-12.96%	1.11%	-16.71%	1.21%	3.75%	-0.10%
自基金合同生效起至今	-26.73%	1.11%	-30.34%	1.16%	3.61%	-0.05%

圆信永丰中证500指数增强发起C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-5.65%	0.90%	-6.55%	0.91%	0.90%	-0.01%
过去三个月	-4.19%	0.98%	-6.16%	1.09%	1.97%	-0.11%
过去六个月	-4.77%	1.41%	-8.46%	1.53%	3.69%	-0.12%
过去一年	-13.23%	1.11%	-16.71%	1.21%	3.48%	-0.10%
自基金合同生效起至今	-27.30%	1.11%	-30.34%	1.16%	3.04%	-0.05%

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





§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

圆信永丰基金管理有限公司是经中国证券监督管理委员会（以下简称"中国证监会"或"证监会"）证监许可[2013]1514号文批准，于2014年1月2日成立的合资基金管理公司。本公司由厦门国际信托有限公司与台湾永丰证券投资信托股份有限公司合资设立，持股

比例分别为51%和49%，注册资本贰亿元人民币。公司注册地位于厦门，主要业务经营团队位于上海，是厦门首家证券投资基金管理公司，也是海西首家两岸合资的证券投资基金管理公司。

截止2024年6月30日，公司旗下共管理31只开放式基金产品，包括4只股票型基金、17只混合型基金、9只债券型基金和1只货币市场基金。

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		
崔长峰	本基金基金经理	2021-12-01	-	11年	上海交通大学金融学博士，现任圆信永丰基金管理有限公司权益投资部基金经理。历任平安资产管理公司量化投资部投资经理，圆信永丰基金管理有限公司专户量化投资部总监、专户一部总监。国籍：中国，获得的相关业务资格：基金从业资格证。

注1：证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

注2：崔长峰的"任职日期"为基金合同生效之日。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，基金管理人本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，在风险可控的前提下为基金份额持有人谋求最大利益。基金管理人遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、该基金基金合同的规定。基金经理对个券和投资组合的比例遵循了投资决策委员会的授权限制，基金投资比例符合基金合同和法律法规的要求。

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，基金管理人贯彻落实《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规和《圆信永丰基金管理有限公司公平交易管理办法》的各项要求，严格规范境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等活动，通过系统和人工相结合的方式进行交易执行和监控分析，以确保基金管理人管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的环节均得到公平对待。

基金管理人各类基金资产、私募资产管理计划资产独立运作。对于交易所市场投资，本公司执行集中交易制度，确保不同投资组合在买卖同一证券时，按照价格优先、时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量；对于银行间市场投资，基金管理人通过交易对手控制和询价机制，严格防范对手风险并抽检价格公允性；对于申购投资行为，基金管理人遵循价格优先、比例分配的原则，根据事前独立申报的价格和数量对交易结果进行公平分配。

报告期内，通过每季度和每年度对不同投资组合之间的收益率差异比较、对同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，基金管理人未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，通过对交易价格、交易时间、交易方向等的抽样分析，基金管理人未发现存在有可能导致不公平交易和利益输送等的异常交易行为。

基金管理人旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

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

2024年上半年，上证指数下跌0.25%，深证成指下跌7.10%，沪深300上涨0.89%，中证500下跌8.96%，中证1000下跌16.84%，中证2000下跌23.28%，中证红利上涨7.75%。表现较好的行业包括银行、煤炭、公用事业，表现较差的行业包括计算机、商贸零售、社会服务。风格上，低波、红利、价值整体表现较好，质量、成长等基本面类相比去年有所回暖，量价技术类表现不如去年，小盘也出现较大幅度的回撤。上半年，基金A类累计取得超额收益3.84%，跟踪误差4.0%，超额收益最大回撤1.7%。2月超额收益为负，其余月份超额收益均为正。2月落后基准的原因是市场在经历年初的流动性冲击后，小盘股和超跌股反弹较多，而基金在低波红利类股票的配置较多，当月产生了一定回撤。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末圆信永丰中证500指数增强发起A基金份额净值为0.7327元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-4.62%，同期业绩比较基准收益率为-8.46%；截至报告

期末圆信永丰中证500指数增强发起C基金份额净值为0.7270元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-4.77%，同期业绩比较基准收益率为-8.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前，债券收益率继续大幅下行，流动性宽松，但股市成交量仍在低位，显示情绪相对较低。国内信贷增速处于低位，海外利率维持高位，但降息预期提高。市场整体的风格仍然偏向防御。基本面确定性高，盈利能力稳健，预期分红较高的股票相对表现较好。展望下半年，我们认为市场仍将处于箱体震荡的格局，风格上继续重视红利，重点关注基本面确定性较高的个股投资机会。

本基金作为指数增强基金，以量化模型为依托，对股票的基本面和市场面信息构建选股模型，捕捉长期基本面优秀，现金流良好，增长稳健，且被市场低估的股票构造投资组合。在风险控制方面，控制组合相对基准指数在主要风险指标上的敞口暴露，保持跟踪误差在目标范围之内。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会相关规定和基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由本基金管理人同本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，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并设立估值委员会具体负责监督执行。估值委员会的成员由首席投资官或其授权代表、清算登记部分管领导、研究部负责人、监察稽核部总监、风险管理部总监、清算登记部总监和经办基金会计组成。估值委员会负责组织制定、评估和适时修订基金估值政策和程序，并指导和监督整个估值流程。估值委员会成员包括基金核算、行业研究等方面的业务骨干，均具有基金从业资格、专业胜任能力和丰富的工作经历，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理不属于公司估值委员会成员，不介入基金日常估值业务。

报告期内，本基金与中央国债登记结算有限责任公司根据《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》而取得中债数据估值服务；本基金与中证指数有限公司根据《中证债券估值数据服务协议》而取得中证数据估值服务。

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进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金为发起式基金，基金合同生效日为2021年12月1日，截至本报告期末生效未满三年，暂不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

§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，国泰君安证券股份有限公司（以下称"本托管人"）在圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金（以下称"本基金"）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况（如有）、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整。

§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：圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	22,531.93	168,202.52
结算备付金		309,046.92	311,345.79
存出保证金		25,336.60	28,400.57
交易性金融资产	6.4.7.2	61,441,472.47	70,707,965.90

其中：股票投资		58,079,443.96	66,834,135.54
基金投资		-	-
债券投资		3,362,028.51	3,873,830.36
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		107,361.53	-
应收股利		-	-
应收申购款		990.14	28,008.78
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		61,906,739.59	71,243,923.56
负债和净资产	**附注号**	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023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		450,000.00	-
应付清算款		70,165.72	-
应付赎回款		-	25,314.56
应付管理人报酬		52,178.88	60,440.04
应付托管费		5,217.90	6,044.03
应付销售服务费		923.82	971.54
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	148,864.33	220,757.46
负债合计		727,350.65	313,527.63
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	83,538,500.80	92,364,330.34
未分配利润	6.4.7.8	-22,359,111.86	-21,433,934.41
净资产合计		61,179,388.94	70,930,395.93
负债和净资产总计		61,906,739.59	71,243,923.56

注：报告截止日2024年6月30日，基金份额总额83,538,500.80份，其中圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金A类基金份额净值0.7327元，圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金A类基金份额78,537,584.15份；圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金C类基金份额净值0.7270元，圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金C类基金份额5,000,916.65份。

6.2 利润表

会计主体：圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日
一、营业总收入		-2,545,420.22	2,306,157.20
1.利息收入		4,380.11	7,936.01
其中：存款利息收入	6.4.7.9	4,354.68	7,936.01
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		25.43	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-138,025.72	708,221.12
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-1,029,874.95	-363,113.22

基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	42,767.96	31,752.09
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	849,081.27	1,039,582.25
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-2,412,538.53	1,589,560.78
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	763.92	439.29
减：二、营业总支出		439,449.48	606,602.94
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	333,507.78	464,113.19
2.托管费	6.4.10.2.2	33,350.72	46,411.37
3.销售服务费	6.4.10.2.3	5,633.72	9,297.91
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		2,312.68	-
其中：卖出回购金融资产支出		2,312.68	-
6.信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7.税金及附加		-	0.02
8.其他费用	6.4.7.20	64,644.58	86,780.45
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,984,869.70	1,699,554.26
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,984,869.70	1,699,554.26
五、其他综合收益的税后		-	-

净额			
六、综合收益总额		-2,984,869.70	1,699,554.26

6.3 净资产变动表

会计主体：圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2024年01月01日至2024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	92,364,330.34	-21,433,934.41	70,930,395.93
二、本期期初净资产	92,364,330.34	-21,433,934.41	70,930,395.93
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-8,825,829.54	-925,177.45	-9,751,006.99
（一）、综合收益总额	-	-2,984,869.70	-2,984,869.70
（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）	-8,825,829.54	2,059,692.25	-6,766,137.29
其中：1.基金申购款	230,859.78	-56,134.28	174,725.50
2.基金赎回款	-9,056,689.32	2,115,826.53	-6,940,862.79
（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	83,538,500.80	-22,359,111.86	61,179,388.94

产			
项 目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023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	122,912,343.77	-20,537,899.42	102,374,444.35
二、本期期初净资产	122,912,343.77	-20,537,899.42	102,374,444.35
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-24,592,306.96	4,959,946.72	-19,632,360.24
（一）、综合收益总额	-	1,699,554.26	1,699,554.26
（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）	-24,592,306.96	3,260,392.46	-21,331,914.50
其中：1.基金申购款	539,938.47	-78,794.77	461,143.70
2.基金赎回款	-25,132,245.43	3,339,187.23	-21,793,058.20
（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	98,320,036.81	-15,577,952.70	82,742,084.11

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:

高健	姚德明	刘雪峰
_____	_____	_____
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

圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]第3074号《关于准予圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》注册，由圆信永丰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《圆信永丰中证500指数增强型发起式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145,480,426.34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(2021)第1112号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于2021年12月1日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为145,517,204.96份基金份额，其中认购资金利息折合36,778.62份基金份额。本基金的基金管理人为圆信永丰基金管理有限公司，基金托管人为国泰君安证券股份有限公司。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为10,001,666.83份基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于3年。

根据《圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金基金合同》和《圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》的规定，本基金根据所收取认购费、申购费、销售服务费用收取方式等差异，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，并不再从该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/申购基金时不收取认购/申购费，而是从该类别基金资产中计提销售服务费，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。本基金A类基金份额和C类基金份额分别设置代码。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告基金份额净值和基金份额累计净值，基金份额净值计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股。此外，本基金的投资范围还可包括国内依法发行上市的非标的指数成份股票(包含主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、港股通标的股票、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、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、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债的纯债部分及其他中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、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的相关规定)。本基金可以根据有关法律法规规定进行融资及转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例不低于80%，其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的20%；投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金的业绩比较基准为：中证500指数收益率×95%＋同期银行活期存款利率(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”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、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2024年中期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2024年6月30日的财务状况以及2024年中期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

本基金本报告期内未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》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。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪

港通/深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。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 2024年06月30日
活期存款	22,531.93
等于：本金	22,516.72
加：应计利息	15.21
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	22,531.93

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		61,321,007.23	-	58,079,443.96	-3,241,563.27
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	3,309,222.30	51,778.51	3,362,028.51	1,027.70
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	3,309,222.30	51,778.51	3,362,028.51	1,027.70
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		64,630,229.53	51,778.51	61,441,472.47	-3,240,535.57

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 2024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	84,219.75
其中：交易所市场	84,219.75
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	64,644.58
合计	148,864.33

注：此处应付赎回费含应付转出费。

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 圆信永丰中证500指数增强发起A

金额单位：人民币元

项目 (圆信永丰中证500指数增强发起A)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	87,363,413.69	87,363,413.69
本期申购	230,859.78	230,859.78
本期赎回（以“-”号填列）	-9,056,689.32	-9,056,689.32
本期末	78,537,584.15	78,537,584.15

6.4.7.7.2 圆信永丰中证500指数增强发起C

金额单位：人民币元

项目 (圆信永丰中证500指数增强发起C)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,000,916.65	5,000,916.65
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	5,000,916.65	5,000,916.65

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 圆信永丰中证500指数增强发起A

单位：人民币元

项目 (圆信永丰中证500指数增强发起A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-20,262,115.50	11,355.50	-20,250,760.00
本期期初	-20,262,115.50	11,355.50	-20,250,760.00
本期利润	-542,206.12	-2,260,754.27	-2,802,960.39
本期基金份额交易产生的变动数	2,203,819.89	-144,127.64	2,059,692.25
其中：基金申购款	-58,085.69	1,951.41	-56,134.28
基金赎回款	2,261,905.58	-146,079.05	2,115,826.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-18,600,501.73	-2,393,526.41	-20,994,028.14

6.4.7.8.2 圆信永丰中证500指数增强发起C

单位：人民币元

项目 (圆信永丰中证500指数增强发起C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,183,410.90	236.49	-1,183,174.41
本期期初	-1,183,410.90	236.49	-1,183,174.41
本期利润	-30,125.05	-151,784.26	-181,909.31
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,213,535.95	-151,547.77	-1,365,083.72

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
活期存款利息收入	840.76
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	3,262.01
其他	251.91
合计	4,354.68

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
卖出股票成交总额	284,423,950.67
减：卖出股票成本总额	285,080,689.59
减：交易费用	373,136.03
买卖股票差价收入	-1,029,874.95

6.4.7.11 基金投资收益

无。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
债券投资收益——利息收入	40,379.27
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,388.69
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-

合计	42,767.96

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,590,307.67
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,503,850.70
减：应计利息总额	84,068.11
减：交易费用	0.17
买卖债券差价收入	2,388.69

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	849,081.27
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	849,081.27

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
1.交易性金融资产	-2,412,538.53
——股票投资	-2,413,566.23
——债券投资	1,027.70
——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	-2,412,538.53

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
基金赎回费收入	763.92
转换费收入	-
合计	763.92

注1：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的50%归入基金资产。

注2：本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金赎回费的50%归入转出基金的基金资产。

6.4.7.19 信用减值损失

无。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
合计	64,644.58

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

本报告期不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。

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
圆信永丰基金管理有限公司（"圆信永丰基金公司"）	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
国泰君安证券股份有限公司（"国泰君安证券"）	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰君安证券	563,163,514.91	100.00%	464,161,134.42	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
国泰君安证券	4,718,933.06	100.00%	5,849,909.46	100.00%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例

国泰君安证券	25,790,000.00	100.00%	0.00	0.00%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安证券	194,751.19	100.00%	84,219.75	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安证券	153,732.06	100.00%	83,475.78	100.00%

注1：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

注2：该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究服务等。

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 2024年01月01日至2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	333,507.78	464,113.19
其中：应支付销售机构的客户维护费	147,196.14	208,667.24

应支付基金管理人的净管理费	186,311.64	255,445.95

注：支付基金管理人圆信永丰基金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：
日管理人报酬＝前一日基金资产净值 × 1.00%/ 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	33,350.72	46,411.37

注：支付基金托管人国泰君安证券的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：
日托管费＝前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	圆信永丰中证500指数增强发起A	圆信永丰中证500指数增强发起C	合计
国泰君安证券	0.00	1,127.11	1,127.11
合计	0.00	1,127.11	1,127.11
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	圆信永丰中证500指数增强发起A	圆信永丰中证500指数增强发起C	合计
国泰君安	0.00	3,482.62	3,482.6

证券			2
合计	0.00	3,482.62	3,482.62

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0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给圆信永丰基金公司，再由圆信永丰基金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 × 0.30%/ 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

圆信永丰中证500指数增强发起A

份额单位：份

项目	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至 2023年06月30日
报告期初持有的基金份额	10,001,666.83	10,001,666.83
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,001,666.83	10,001,666.83
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	12.73%	10.72%

注：报告期末持有的基金份额占比为占A类基金总份额的比例。

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 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023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
国泰君安证券-活期存款	22,531.93	840.76	474,030.97	4,674.97

注：本基金的活期银行存款账户由本基金托管人国泰君安证券开立在兴业银行股份有限公司，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（2024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：债券										
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：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113685	升24转债	2024-06-1	1个月内（含）	新债未上	100.00	100.01	20	2,000.00	2,000.15	-

		7		市						

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

截至本报告期末2024年6月30日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额450,000.00元，于2024年7月1日先后到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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

本基金为股票型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金为股票型指数增强基金，具有与标的指数相似的风险收益特征，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制，力争获取高于标的指数的投资收益。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股。此外，为更好地实现投资目标，本基金的投资范围还可包括国内依法发行上市的非标的指数成份股票（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）、港股通标的股票、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、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、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债的纯债部分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（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、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）。

本基金的基金管理人实行全面风险管理与全员风险管理。基金管理人以各岗位目标责任制为基础的第一道内控防线，员工在自律的前提下，相互监督制衡。各岗位职责明

确，有详细的岗位说明书和业务流程，各岗位人员在授权范围内承担责任；以相关部门、相关岗位之间相互监督制衡的第二道内控防线，公司在相关部门和相关岗位之间建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，后续部门及岗位对前一部门及岗位负有监督责任；以公司督察长、监察稽核部门对各岗位、各部门、各机构、各项业务全面实施监督反馈的第三道防线，督察长、监察稽核部门独立于其他部门，对内部控制制度的执行情况实行严格的检查和反馈；以董事会下属风险与合规管理委员会对公司经营管理和基金运作中的合法合规性实行全面监督的第四道防线。风险与合规管理委员会对公司经营和基金运作中的风险进行严格的合规检查和风险控制评估并审议公司风险管理工作报告。董事会对基金管理人的风险管理负有最终责任。

本基金的基金管理人建立科学严密的风险评估体系，对内外部风险进行识别、评估和分析，及时防范和化解风险；建立完整的风险控制程序，包括风险识别、风险评估、风险控制和风险监督；对各部门和各业务循环存在的风险点进行识别评估，并建立相应的控制措施；使用科学的风险量化技术和严格的风险限额控制对投资风险实行定量分析和管理。

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国泰君安证券开立于兴业银行股份有限公司的托管账户，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，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-

A-1以下	-	-
未评级	3,360,028.36	3,873,830.36
合计	3,360,028.36	3,873,830.36

注：未评级债券为国债。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	2,000.15	-
未评级	-	-
合计	2,000.15	-

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

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

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2024年6月30日，除卖出回购金融资产款余额中有450,000.00元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他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，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短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发行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%。于2024年6月30日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为0.003%。

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2024年6月30日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值为61,500,174.99元，超过经确认的当日净赎回金额。

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

产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、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、结算备付金、存出保证金和债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2024年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	22,531.93	-	-	-	22,531.93
结算备付金	309,046.92	-	-	-	309,046.92
存出保证金	25,336.60	-	-	-	25,336.60
交易性金融资产	3,360,028.36	-	2,000.15	58,079,443.96	61,441,472.47
应收清算款	-	-	-	107,361.53	107,361.53

应收申购款	-	-	-	990.14	990.14
资产总计	3,716,943.81	-	2,000.15	58,187,795.63	61,906,739.59
负债					
卖出回购金融资产款	450,000.00	-	-	-	450,000.00
应付清算款	-	-	-	70,165.72	70,165.72
应付管理人报酬	-	-	-	52,178.88	52,178.88
应付托管费	-	-	-	5,217.90	5,217.90
应付销售服务费	-	-	-	923.82	923.82
其他负债	-	-	-	148,864.33	148,864.33
负债总计	450,000.00	-	-	277,350.65	727,350.65
利率敏感度缺口	3,266,943.81	-	2,000.15	57,910,444.98	61,179,388.94
上年度末2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	168,202.52	-	-	-	168,202.52
结算备付金	311,345.79	-	-	-	311,345.79
存出保证金	28,400.57	-	-	-	28,400.57

交易性金融资产	3,873,830.36	-	-	66,834,135.54	70,707,965.90
应收申购款	-	-	-	28,008.78	28,008.78
资产总计	4,381,779.24	-	-	66,862,144.32	71,243,923.56
负债					
应付赎回款	-	-	-	25,314.56	25,314.56
应付管理人报酬	-	-	-	60,440.04	60,440.04
应付托管费	-	-	-	6,044.03	6,044.03
应付销售服务费	-	-	-	971.54	971.54
其他负债	-	-	-	220,757.46	220,757.46
负债总计	-	-	-	313,527.63	313,527.63
利率敏感度缺口	4,381,779.24	-	-	66,548,616.69	70,930,395.93

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2024年6月30日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为5.50%(2023年12月31日：5.46%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2023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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。基金的投资组合比例为：本基金所持有的股票资产占基金资产的比例不低于80%，其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的20%；投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。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 2024年06月30日		上年度末 2023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	58,079,443.96	94.93	66,834,135.54	94.22
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	58,079,443.96	94.93	66,834,135.54	94.22

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证500指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	1.中证500指数上升5%	3,813,342.62	2,613,893.30
	2.中证500指数下降5%	-3,813,342.62	-2,613,893.30

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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	58,079,443.96	66,834,135.54
第二层次	3,362,028.51	3,873,830.36

第三层次	-	-
合计	61,441,472.47	70,707,965.90

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2024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(2023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	58,079,443.96	93.82
	其中：股票	58,079,443.96	93.82
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,362,028.51	5.43
	其中：债券	3,362,028.51	5.43
	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	331,578.85	0.54
8	其他各项资产	133,688.27	0.22
9	合计	61,906,739.59	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	435,687.00	0.71
B	采矿业	2,610,144.00	4.27
C	制造业	36,034,565.00	58.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,485,997.00	4.06
E	建筑业	562,363.00	0.92
F	批发和零售业	1,545,717.32	2.53
G	交通运输、仓储和邮政业	1,414,630.00	2.31
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,398,964.84	7.19
J	金融业	2,110,702.00	3.45
K	房地产业	463,505.00	0.76
L	租赁和商务服务业	174,162.00	0.28
M	科学研究和技术服务业	316,953.00	0.52
N	水利、环境和公共设施管理业	76,521.00	0.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	52,479.00	0.09
Q	卫生和社会工作	51,661.00	0.08

R	文化、体育和娱乐业	1,467,336.00	2.40
S	综合	55,616.00	0.09
	合计	54,257,003.16	88.69

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	-	-
B	采矿业	84,878.00	0.14
C	制造业	3,371,340.80	5.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	85,293.00	0.14
G	交通运输、仓储和邮政业	58,065.00	0.09
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	115,344.00	0.19
J	金融业	-	-
K	房地产业	57,096.00	0.09
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	50,424.00	0.08
S	综合	-	-
	合计	3,822,440.80	6.25

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	002138	顺络电子	26,300	722,198.00	1.18
2	002984	森麒麟	28,200	679,338.00	1.11
3	000887	中鼎股份	51,000	624,240.00	1.02
4	601717	郑煤机	41,300	611,240.00	1.00
5	002429	兆驰股份	121,500	584,415.00	0.96
6	600066	宇通客车	21,900	565,020.00	0.92
7	000830	鲁西化工	48,000	556,320.00	0.91
8	300383	光环新网	62,700	529,815.00	0.87
9	300866	安克创新	7,440	529,802.40	0.87
10	600529	山东药玻	20,900	529,606.00	0.87
11	002152	广电运通	48,100	503,126.00	0.82
12	600282	南钢股份	100,900	502,482.00	0.82
13	002273	水晶光电	29,400	499,212.00	0.82
14	000513	丽珠集团	13,300	494,893.00	0.81
15	600801	华新水泥	35,800	492,250.00	0.80
16	000423	东阿阿胶	7,800	488,280.00	0.80
17	002595	豪迈科技	12,000	458,040.00	0.75
18	601058	赛轮轮胎	32,400	453,600.00	0.74
19	000027	深圳能源	61,700	450,410.00	0.74
20	600208	新湖中宝	282,900	446,982.00	0.73
21	002557	洽洽食品	15,800	445,402.00	0.73
22	601231	环旭电子	27,400	439,770.00	0.72

23	688425	铁建重工	117,578	432,687.04	0.71
24	000630	铜陵有色	119,600	431,756.00	0.71
25	600598	北大荒	33,900	423,411.00	0.69
26	000997	新 大 陆	30,404	422,919.64	0.69
27	300296	利亚德	90,700	408,150.00	0.67
28	688188	柏楚电子	2,180	402,319.00	0.66
29	600873	梅花生物	39,900	399,798.00	0.65
30	600582	天地科技	58,000	399,620.00	0.65
31	300677	英科医疗	14,900	399,469.00	0.65
32	600885	宏发股份	14,400	398,592.00	0.65
33	603156	养元饮品	18,700	397,749.00	0.65
34	601000	唐山港	82,900	389,630.00	0.64
35	002128	电投能源	18,200	384,020.00	0.63
36	600901	江苏金租	75,900	383,295.00	0.63
37	600707	彩虹股份	56,000	381,360.00	0.62
38	002019	亿帆医药	30,100	372,036.00	0.61
39	601168	西部矿业	20,600	369,770.00	0.60
40	688002	睿创微纳	13,100	366,407.00	0.60
41	600511	国药股份	11,900	366,401.00	0.60
42	600380	健康元	32,800	366,376.00	0.60
43	600352	浙江龙盛	42,500	365,075.00	0.60
44	603883	老百姓	19,740	362,426.40	0.59
45	300144	宋城演艺	45,000	361,350.00	0.59
46	600967	内蒙一机	49,300	354,960.00	0.58
47	600566	济川药业	11,100	351,981.00	0.58
48	600820	隧道股份	53,000	346,090.00	0.57
49	688349	三一重能	13,900	345,276.00	0.56
50	002028	思源电气	5,100	341,190.00	0.56
51	002064	华峰化学	47,500	340,575.00	0.56
52	002195	岩山科技	133,300	334,583.00	0.55
53	600737	中粮糖业	34,500	330,855.00	0.54

54	600535	天士力	26,100	328,338.00	0.54
55	002532	天山铝业	39,500	320,345.00	0.52
56	300017	网宿科技	40,500	319,950.00	0.52
57	688617	惠泰医疗	700	319,270.00	0.52
58	600549	厦门钨业	18,500	319,125.00	0.52
59	001203	大中矿业	33,100	318,091.00	0.52
60	688375	国博电子	4,500	317,880.00	0.52
61	002203	海亮股份	39,400	314,412.00	0.51
62	600062	华润双鹤	16,000	313,280.00	0.51
63	000060	中金岭南	72,200	306,128.00	0.50
64	002065	东华软件	67,500	305,100.00	0.50
65	300009	安科生物	35,100	299,754.00	0.49
66	688778	厦钨新能	9,410	293,968.40	0.48
67	000598	兴蓉环境	38,900	292,528.00	0.48
68	688779	长远锂科	62,900	291,227.00	0.48
69	601636	旗滨集团	44,600	287,670.00	0.47
70	002340	格林美	44,700	284,739.00	0.47
71	600642	申能股份	31,400	277,262.00	0.45
72	601098	中南传媒	22,100	274,482.00	0.45
73	601966	玲珑轮胎	14,800	271,876.00	0.44
74	002465	海格通信	25,600	265,216.00	0.43
75	603529	爱玛科技	9,700	265,101.00	0.43
76	601216	君正集团	71,400	263,466.00	0.43
77	002508	老板电器	11,900	262,990.00	0.43
78	600959	江苏有线	99,600	262,944.00	0.43
79	688281	华秦科技	3,120	259,958.40	0.42
80	688819	天能股份	10,878	259,549.08	0.42
81	002831	裕同科技	10,000	255,900.00	0.42
82	603927	中科软	14,080	254,707.20	0.42
83	603160	汇顶科技	3,700	254,375.00	0.42
84	000050	深天马A	34,900	254,072.00	0.42

85	600373	中文传媒	16,900	250,796.00	0.41
86	601568	北元集团	67,100	248,941.00	0.41
87	000563	陕国投A	90,400	248,600.00	0.41
88	603225	新凤鸣	15,900	247,881.00	0.41
89	600157	永泰能源	206,400	243,552.00	0.40
90	000738	航发控制	12,100	242,847.00	0.40
91	600299	安迪苏	24,900	241,530.00	0.39
92	688276	百克生物	8,500	241,145.00	0.39
93	601016	节能风电	80,400	240,396.00	0.39
94	601156	东航物流	11,700	238,095.00	0.39
95	603298	杭叉集团	12,000	235,680.00	0.39
96	600096	云天化	12,100	234,982.00	0.38
97	600361	创新新材	56,400	227,292.00	0.37
98	000883	湖北能源	36,800	221,168.00	0.36
99	300054	鼎龙股份	9,700	219,996.00	0.36
100	688516	奥特维	5,200	217,412.00	0.36
101	603979	金诚信	4,300	217,279.00	0.36
102	002563	森马服饰	36,900	214,389.00	0.35
103	000921	海信家电	6,600	212,784.00	0.35
104	603233	大参林	14,800	211,640.00	0.35
105	300502	新易盛	2,000	211,100.00	0.35
106	600528	中铁工业	27,800	203,496.00	0.33
107	600008	首创环保	75,100	201,268.00	0.33
108	603939	益丰药房	7,940	194,927.00	0.32
109	300724	捷佳伟创	3,600	194,436.00	0.32
110	002281	光迅科技	5,200	194,324.00	0.32
111	601019	山东出版	16,300	192,666.00	0.31
112	000703	恒逸石化	27,000	191,430.00	0.31
113	000039	中集集团	20,300	187,978.00	0.31
114	600497	驰宏锌锗	35,000	186,900.00	0.31
115	300390	天华新能	10,800	185,544.00	0.30

116	002517	恺英网络	19,400	185,270.00	0.30
117	600377	宁沪高速	14,700	185,220.00	0.30
118	601928	凤凰传媒	16,500	180,840.00	0.30
119	300251	光线传媒	21,000	176,610.00	0.29
120	601958	金钼股份	16,700	173,847.00	0.28
121	000878	云南铜业	13,800	171,948.00	0.28
122	600699	均胜电子	11,600	171,912.00	0.28
123	601108	财通证券	24,100	159,301.00	0.26
124	600925	苏能股份	31,500	159,075.00	0.26
125	300136	信维通信	7,900	154,682.00	0.25
126	002506	协鑫集成	79,500	154,230.00	0.25
127	000728	国元证券	24,800	150,288.00	0.25
128	300529	健帆生物	5,500	149,655.00	0.24
129	600521	华海药业	8,700	148,335.00	0.24
130	300253	卫宁健康	24,900	146,910.00	0.24
131	002608	江苏国信	18,800	145,700.00	0.24
132	300394	天孚通信	1,640	145,008.80	0.24
133	603317	天味食品	12,600	143,766.00	0.23
134	600909	华安证券	34,100	143,561.00	0.23
135	601298	青岛港	15,000	143,400.00	0.23
136	000709	河钢股份	73,900	143,366.00	0.23
137	600863	内蒙华电	30,800	142,912.00	0.23
138	601880	辽港股份	112,100	137,883.00	0.23
139	600998	九州通	28,134	137,293.92	0.22
140	600563	法拉电子	1,800	137,124.00	0.22
141	603379	三美股份	3,500	136,990.00	0.22
142	601608	中信重工	35,600	135,636.00	0.22
143	600968	海油发展	32,500	133,900.00	0.22
144	600970	中材国际	11,100	133,866.00	0.22
145	600655	豫园股份	25,700	132,355.00	0.22
146	688234	天岳先进	2,800	131,376.00	0.21

147	300002	神州泰岳	16,100	130,732.00	0.21
148	000937	冀中能源	19,500	130,650.00	0.21
149	601577	长沙银行	15,800	129,244.00	0.21
150	600350	山东高速	14,600	129,210.00	0.21
151	300207	欣旺达	8,400	127,428.00	0.21
152	300146	汤臣倍健	9,400	127,370.00	0.21
153	002155	湖南黄金	6,900	124,890.00	0.20
154	000825	太钢不锈	36,900	124,722.00	0.20
155	603444	吉比特	700	124,607.00	0.20
156	688248	南网科技	4,200	124,446.00	0.20
157	002056	横店东磁	9,900	123,453.00	0.20
158	601162	天风证券	56,500	123,170.00	0.20
159	688538	和辉光电	61,800	122,364.00	0.20
160	603087	甘李药业	2,600	120,432.00	0.20
161	300088	长信科技	25,400	119,380.00	0.20
162	688153	唯捷创芯	3,206	118,622.00	0.19
163	688169	石头科技	300	117,780.00	0.19
164	601992	金隅集团	85,700	117,409.00	0.19
165	002683	广东宏大	5,800	116,754.00	0.19
166	600985	淮北矿业	6,900	115,506.00	0.19
167	002025	航天电器	2,400	111,312.00	0.18
168	001872	招商港口	5,700	109,725.00	0.18
169	600879	航天电子	14,100	109,557.00	0.18
170	601077	渝农商行	21,600	108,432.00	0.18
171	001286	陕西能源	9,400	108,382.00	0.18
172	688099	晶晨股份	1,800	106,776.00	0.17
173	000401	冀东水泥	26,000	105,560.00	0.17
174	000009	中国宝安	12,200	104,920.00	0.17
175	002078	太阳纸业	7,500	104,625.00	0.17
176	600498	烽火通信	6,500	103,350.00	0.17
177	000750	国海证券	34,400	100,104.00	0.16

178	000967	盈峰环境	23,500	99,405.00	0.16
179	600580	卧龙电驱	8,100	98,415.00	0.16
180	003035	南网能源	22,200	97,680.00	0.16
181	002690	美亚光电	5,900	97,350.00	0.16
182	688475	萤石网络	2,700	92,097.00	0.15
183	688777	中控技术	2,400	90,480.00	0.15
184	600038	中直股份	2,200	90,442.00	0.15
185	601567	三星医疗	2,500	87,500.00	0.14
186	000559	万向钱潮	19,500	86,970.00	0.14
187	600704	物产中大	20,000	86,800.00	0.14
188	000933	神火股份	4,200	84,966.00	0.14
189	688525	佰维存储	1,300	83,395.00	0.14
190	002373	千方科技	9,100	82,537.00	0.13
191	000636	风华高科	6,200	80,972.00	0.13
192	000683	远兴能源	11,700	80,847.00	0.13
193	600170	上海建工	37,200	79,980.00	0.13
194	600637	东方明珠	12,800	77,824.00	0.13
195	000623	吉林敖东	5,800	77,720.00	0.13
196	000156	华数传媒	12,300	77,244.00	0.13
197	603786	科博达	1,200	76,980.00	0.13
198	002439	启明星辰	4,400	75,944.00	0.12
199	600927	永安期货	6,800	75,820.00	0.12
200	601179	中国西电	9,300	74,772.00	0.12
201	600583	海油工程	12,400	73,284.00	0.12
202	600098	广州发展	11,400	72,960.00	0.12
203	002202	金风科技	10,500	70,560.00	0.12
204	002384	东山精密	3,400	70,380.00	0.12
205	600755	厦门国贸	9,500	68,115.00	0.11
206	688213	思特威	1,400	67,900.00	0.11
207	000785	居然之家	27,900	67,797.00	0.11
208	002531	天顺风能	7,500	67,050.00	0.11

209	000958	电投产融	18,200	66,612.00	0.11
210	300037	新宙邦	2,300	65,688.00	0.11
211	300001	特锐德	3,200	64,384.00	0.11
212	300285	国瓷材料	3,600	64,260.00	0.11
213	600177	雅戈尔	8,700	61,944.00	0.10
214	603486	科沃斯	1,300	61,334.00	0.10
215	601990	南京证券	7,700	59,136.00	0.10
216	600517	国网英大	13,300	57,589.00	0.09
217	688017	绿的谐波	700	57,470.00	0.09
218	000021	深科技	3,800	57,456.00	0.09
219	002756	永兴材料	1,600	57,248.00	0.09
220	688120	华海清科	300	56,874.00	0.09
221	002223	鱼跃医疗	1,500	56,400.00	0.09
222	600348	华阳股份	5,600	55,776.00	0.09
223	600673	东阳光	7,900	55,616.00	0.09
224	002423	中粮资本	7,400	55,426.00	0.09
225	002507	涪陵榨菜	4,500	55,125.00	0.09
226	300601	康泰生物	3,500	54,635.00	0.09
227	600862	中航高科	2,900	54,462.00	0.09
228	002444	巨星科技	2,200	54,340.00	0.09
229	600390	五矿资本	13,400	54,270.00	0.09
230	601212	白银有色	19,500	54,210.00	0.09
231	600827	百联股份	7,300	53,874.00	0.09
232	600418	江淮汽车	3,400	53,856.00	0.09
233	003031	中瓷电子	1,160	53,638.40	0.09
234	688521	芯原股份	2,000	53,500.00	0.09
235	601598	中国外运	9,500	53,485.00	0.09
236	603688	石英股份	1,800	53,298.00	0.09
237	600079	人福医药	3,100	53,227.00	0.09
238	000987	越秀资本	10,600	52,576.00	0.09
239	002607	中公教育	34,300	52,479.00	0.09

240	688006	杭可科技	3,000	52,350.00	0.09
241	002240	盛新锂能	3,900	52,338.00	0.09
242	603728	鸣志电器	1,300	52,299.00	0.09
243	300861	美畅股份	2,700	52,245.00	0.09
244	300212	易华录	3,100	52,173.00	0.09
245	603456	九洲药业	3,800	52,136.00	0.09
246	000778	新兴铸管	14,900	51,852.00	0.08
247	688567	孚能科技	5,400	51,840.00	0.08
248	603882	金域医学	1,900	51,661.00	0.08
249	002156	通富微电	2,300	51,497.00	0.08
250	002518	科士达	2,900	51,330.00	0.08
251	002268	电科网安	3,600	51,228.00	0.08
252	000729	燕京啤酒	5,800	51,214.00	0.08
253	603589	口子窖	1,300	50,947.00	0.08
254	000932	华菱钢铁	11,400	50,502.00	0.08
255	600481	双良节能	10,800	50,436.00	0.08
256	603185	弘元绿能	2,932	50,107.88	0.08
257	688063	派能科技	1,260	50,034.60	0.08
258	601965	中国汽研	2,900	48,981.00	0.08
259	002153	石基信息	8,500	48,705.00	0.08
260	600867	通化东宝	5,800	48,546.00	0.08
261	002266	浙富控股	17,100	47,709.00	0.08
262	688561	奇安信	2,000	47,240.00	0.08
263	002850	科达利	600	45,828.00	0.07
264	688107	安路科技	1,800	45,756.00	0.07
265	603000	人民网	2,200	43,978.00	0.07
266	002414	高德红外	7,300	42,997.00	0.07
267	002865	钧达股份	1,100	42,218.00	0.07
268	600060	海信视像	1,700	42,058.00	0.07
269	002791	坚朗五金	1,600	41,392.00	0.07
270	002625	光启技术	2,300	39,905.00	0.07

271	603127	昭衍新药	3,000	39,810.00	0.07
272	601828	美凯龙	15,000	38,250.00	0.06
273	603712	七一二	2,100	38,199.00	0.06
274	002945	华林证券	3,800	37,924.00	0.06
275	600416	湘电股份	3,800	37,772.00	0.06
276	002558	巨人网络	3,700	34,928.00	0.06
277	603305	旭升集团	3,300	34,848.00	0.06
278	300438	鹏辉能源	1,800	33,012.00	0.05
279	601666	平煤股份	2,900	32,480.00	0.05
280	688180	君实生物	1,100	31,955.00	0.05
281	600398	海澜之家	3,400	31,416.00	0.05
282	002624	完美世界	4,100	31,160.00	0.05
283	601858	中国科传	1,600	30,592.00	0.05
284	000723	美锦能源	6,300	29,988.00	0.05
285	603568	伟明环保	1,400	28,812.00	0.05
286	600536	中国软件	900	26,928.00	0.04
287	601128	常熟银行	3,500	26,495.00	0.04
288	688331	荣昌生物	600	25,920.00	0.04
289	002120	韵达股份	3,300	25,542.00	0.04
290	002487	大金重工	1,100	25,168.00	0.04
291	688385	复旦微电	800	25,104.00	0.04
292	688029	南微医学	400	24,624.00	0.04
293	300357	我武生物	1,200	24,264.00	0.04
294	601233	桐昆股份	1,500	23,940.00	0.04
295	300595	欧普康视	1,500	23,520.00	0.04
296	600906	财达证券	4,100	23,493.00	0.04
297	600315	上海家化	1,300	23,114.00	0.04
298	300765	新诺威	900	22,707.00	0.04
299	300568	星源材质	2,700	22,140.00	0.04
300	603077	和邦生物	12,900	21,285.00	0.03
301	600871	石化油服	10,300	17,922.00	0.03

302	002966	苏州银行	2,100	15,750.00	0.03
303	603596	伯特利	400	15,560.00	0.03
304	603606	东方电缆	300	14,643.00	0.02
305	300763	锦浪科技	300	12,492.00	0.02
306	000960	锡业股份	800	12,392.00	0.02
307	600578	京能电力	3,800	12,312.00	0.02
308	002299	圣农发展	900	12,276.00	0.02
309	600848	上海临港	1,300	11,843.00	0.02
310	301236	软通动力	300	10,563.00	0.02
311	601991	大唐发电	3,500	10,535.00	0.02
312	300073	当升科技	300	10,293.00	0.02
313	600399	抚顺特钢	1,700	9,571.00	0.02
314	000629	钒钛股份	3,800	9,500.00	0.02
315	600839	四川长虹	1,700	7,633.00	0.01
316	002353	杰瑞股份	200	7,016.00	0.01
317	300012	华测检测	600	6,036.00	0.01
318	000031	大悦城	2,000	4,680.00	0.01
319	002372	伟星新材	200	3,084.00	0.01
320	601228	广州港	800	2,440.00	0.00
321	601611	中国核建	300	2,427.00	0.00
322	603517	绝味食品	100	1,540.00	0.00
323	600928	西安银行	400	1,308.00	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	688510	航亚科技	11,500	211,715.00	0.35
2	603579	荣泰健康	11,280	174,388.80	0.29
3	688076	诺泰生物	1,900	148,732.00	0.24

4	002922	伊戈尔	6,100	133,346.00	0.22
5	002947	恒铭达	3,700	130,240.00	0.21
6	301000	肇民科技	8,980	128,863.00	0.21
7	301106	骏成科技	4,200	120,750.00	0.20
8	002916	深南电路	1,100	116,347.00	0.19
9	002130	沃尔核材	8,200	115,784.00	0.19
10	002322	理工能科	7,200	115,344.00	0.19
11	002463	沪电股份	3,000	109,500.00	0.18
12	000528	柳 工	9,500	106,305.00	0.17
13	300610	晨化股份	12,100	106,117.00	0.17
14	600420	国药现代	9,700	103,596.00	0.17
15	300590	移为通信	8,700	99,354.00	0.16
16	000551	创元科技	11,200	97,776.00	0.16
17	603992	松霖科技	5,300	97,467.00	0.16
18	300233	金城医药	6,500	96,980.00	0.16
19	002371	北方华创	300	95,967.00	0.16
20	688150	莱特光电	4,900	95,060.00	0.16
21	300926	博俊科技	4,700	94,094.00	0.15
22	300809	华辰装备	4,500	91,170.00	0.15
23	605488	福莱新材	6,800	88,400.00	0.14
24	002906	华阳集团	3,300	88,308.00	0.14
25	300547	川环科技	5,400	88,290.00	0.14
26	300174	元力股份	6,300	85,995.00	0.14
27	300783	三只松鼠	3,900	85,293.00	0.14
28	600547	山东黄金	3,100	84,878.00	0.14
29	002722	物产金轮	7,500	84,750.00	0.14
30	600186	莲花控股	24,500	84,035.00	0.14
31	002437	誉衡药业	49,300	83,810.00	0.14
32	002536	飞龙股份	8,600	81,872.00	0.13
33	000403	派林生物	3,000	79,980.00	0.13
34	002847	盐津铺子	1,700	72,709.00	0.12

35	603730	岱美股份	6,000	59,640.00	0.10
36	001213	中铁特货	14,700	58,065.00	0.09
37	600007	中国国贸	2,600	57,096.00	0.09
38	601921	浙版传媒	6,600	50,424.00	0.08

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	600418	江淮汽车	1,736,175.00	2.45
2	601168	西部矿业	1,484,795.00	2.09
3	600863	内蒙华电	1,470,357.00	2.07
4	600482	中国动力	1,426,691.00	2.01
5	300212	易华录	1,420,578.00	2.00
6	300383	光环新网	1,418,065.00	2.00
7	603156	养元饮品	1,389,066.00	1.96
8	002152	广电运通	1,370,811.00	1.93
9	000887	中鼎股份	1,355,142.00	1.91
10	000630	铜陵有色	1,341,187.00	1.89
11	000728	国元证券	1,338,325.00	1.89
12	688002	睿创微纳	1,332,263.07	1.88
13	600879	航天电子	1,329,929.00	1.87
14	601958	金钼股份	1,309,255.00	1.85
15	002429	兆驰股份	1,302,008.34	1.84
16	000581	威孚高科	1,299,789.00	1.83
17	600066	宇通客车	1,291,702.00	1.82
18	600177	雅戈尔	1,254,758.00	1.77
19	603233	大参林	1,234,469.21	1.74
20	603939	益丰药房	1,214,042.00	1.71

注："买入股票成本"或"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	600863	内蒙华电	1,989,708.00	2.81
2	600482	中国动力	1,764,955.00	2.49
3	000581	威孚高科	1,756,574.00	2.48
4	600497	驰宏锌锗	1,748,672.00	2.47
5	600418	江淮汽车	1,605,885.00	2.26
6	603156	养元饮品	1,566,336.00	2.21
7	000630	铜陵有色	1,545,678.00	2.18
8	002422	科伦药业	1,526,595.00	2.15
9	600642	申能股份	1,480,683.00	2.09
10	600177	雅戈尔	1,475,870.00	2.08
11	600066	宇通客车	1,408,102.00	1.99
12	600707	彩虹股份	1,400,230.00	1.97
13	600161	天坛生物	1,372,338.20	1.93
14	600879	航天电子	1,354,270.00	1.91
15	002064	华峰化学	1,350,160.00	1.90
16	000958	电投产融	1,324,986.00	1.87
17	300001	特锐德	1,315,004.00	1.85
18	300017	网宿科技	1,314,372.22	1.85
19	601958	金钼股份	1,313,323.00	1.85
20	600985	淮北矿业	1,310,003.00	1.85

注："买入股票成本"或"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	278,739,564.24
卖出股票收入（成交）总额	284,423,950.67

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	3,360,028.36	5.49
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	2,000.15	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,362,028.51	5.50

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019727	23国债24	33,000	3,360,028.36	5.49
2	113685	升24转债	20	2,000.15	0.00

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

根据基金合同约定，本基金不参与贵金属投资。

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

根据基金合同约定，本基金不参与权证投资。

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持有股指期货合约。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明

通过查阅中国证监会、国家金融监督管理总局网站公开目录“行政处罚决定”及查阅相关发行主体的公司公告，在基金管理人知悉的范围内，报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体中，青岛森麒麟轮胎股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到青岛市即墨区消防救援大队的处罚。鲁西化工集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到聊城市高新区应急管理局的处罚。深圳顺络电子股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到深圳市公安局龙华分局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金前十名股票未超出基金合同规定备选股票库。

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	25,336.60
2	应收清算款	107,361.53
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	990.14

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	133,688.27

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的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中未存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金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	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
圆信永丰中证500指数增强发	1,279	61,405.46	10,100,710.06	12.86%	68,436,874.09	87.14%

起A						
圆信永丰中证500指数增强发起C	5	1,000,183.33	0.00	0.00%	5,000,916.65	100.00%
合计	1,284	65,061.14	10,100,710.06	12.09%	73,437,790.74	87.91%

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	圆信永丰中证500指数增强发起A	183,073.68	0.23%
	圆信永丰中证500指数增强发起C	-	-
	合计	183,073.68	0.22%

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	圆信永丰中证500指数增强发起A	0~10
	圆信永丰中证500指数增强发起C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	圆信永丰中证500指数增强发起A	10~50
	圆信永丰中证500指数增强发起C	0

	合计	10~50

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,666.83	11.97%	10,001,666.83	11.97%	不少于3年
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金经理等人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	10,001,666.83	11.97%	10,001,666.83	11.97%	不少于3年

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	圆信永丰中证500指数增强发起A	圆信永丰中证500指数增强发起C
基金合同生效日(2021年12月01日)基金份额总额	135,514,663.33	10,002,541.63
本报告期期初基金份额总额	87,363,413.69	5,000,916.65
本报告期基金总申购份额	230,859.78	-
减：本报告期基金总赎回份额	9,056,689.32	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	78,537,584.15	5,000,916.65

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，未召开基金份额持有人大会且无决议。

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

报告期内，基金管理人的重大人事变动：2024年4月1日，范妍女士离任公司副总经理。2024年4月30日，吴莉芳女士离任公司副总经理兼财务负责人；同日，苏东升先生新任公司副总经理兼财务负责人。

本报告期内，南翰仪同志任职国泰君安证券资产托管部副总经理(主持工作)。陈忠义同志任国泰君安证券公司副总裁，不再兼任资产托管部总经理职务。具体信息参见国泰君安证券资产托管与基金服务网站公告《关于国泰君安证券股份有限公司资产托管部负责人变更的公告》。

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

本报告期内，本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，基金管理人及其高级管理人员均未受稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，托管人及其高级管理人员均未受稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元	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	佣金	占当期佣金总量的比	

	数量		的比例		例	
国泰君安	3	563,163,514.91	100.00%	194,751.19	100.00%	-

注1：本报告期内基金无新增证券公司交易单元。

注2：本基金管理人负责选择证券公司，租用其交易单元作为本基金的交易单元。本基金管理人选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司参与证券交易。选择租用证券公司基金交易单元的标准如下：

（1）资金实力雄厚，财务状况良好；

（2）经营行为稳健规范，在业内有良好的声誉；

（3）内控制度健全，内部管理严格，具有良好的合规风控能力，并能满足基金运作高度保密的要求；

（4）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要，并能为基金管理提供全面的信息服务；

（5）研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员；

（6）具备较强的全方位金融研究、服务能力和水平。

注3：基金选择证券公司交易单元的程序如下：

（1）本基金管理人对证券公司的经营管理能力、资金及财务状况、合规风控能力、交易服务能力、研究服务能力等各项指标进行评价，经相应审批后确定选用交易单元的证券公司；

（2）本基金管理人与被选中的证券公司签订交易单元租用协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		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
国泰君安	4,718,933.06	100.00%	25,790,000.00	100.00%	-	-	-	-

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	圆信永丰中证500指数增强	证监会规定媒介	2024-01-22

	型发起式证券投资基金2023年第四季度报告		
2	圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金2023年年度报告	证监会规定媒介	2024-03-29
3	4 圆信永丰基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证监会规定媒介	2024-04-03
4	圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金2024年第一季度报告	证监会规定媒介	2024-04-22
5	4 圆信永丰基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证监会规定媒介	2024-04-30
6	圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新	证监会规定媒介	2024-06-28

§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

报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会批准圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金设立的文件；

2、《圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；

3、《圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金托管协议》；

4、报告期内在规定报刊上披露的各项公告；

5、基金管理人业务资格批件、营业执照；

6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人圆信永丰基金管理有限公司。

咨询电话：4006070088

公司网址：http://www.gtsfund.com.cn

圆信永丰基金管理有限公司

二〇二四年八月三十日