

财通沪深 300 指数增强型证券投资基金 2025 年中期报告

2025 年 06 月 30 日

基金管理人:财通基金管理有限公司

基金托管人:中国光大银行股份有限公司

送出日期:2025 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、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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2025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、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2025年01月01日起至2025年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	61
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	63
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	63
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	63
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	63

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	63
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	63
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	63
7.12 投资组合报告附注.....	64
§8 基金份额持有人信息.....	65
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	65
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	65
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	65
§9 开放式基金份额变动.....	65
§10 重大事件揭示.....	66
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.....	67
10.8 其他重大事件.....	68
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	69
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.....	69
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	69
§12 备查文件目录.....	69
12.1 备查文件目录.....	69
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	财通沪深300指数增强型证券投资基金
基金简称	财通沪深300指数增强
场内简称	-
基金主代码	005850
交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年12月21日
基金管理人	财通基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	215,480,874.20份
基金合同存续期	不定期

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

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

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

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2025年01月01日 - 2025年06月30日)
本期已实现收益	4,680,283.16
本期利润	8,728,774.81
加权平均基金份额本期利润	0.0319
本期加权平均净值利润率	2.20%
本期基金份额净值增长率	2.49%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2025年06月30日)
期末可供分配利润	96,135,969.01
期末可供分配基金份额利润	0.4461
期末基金资产净值	321,184,234.43
期末基金份额净值	1.4905
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2025年06月30日)
基金份额累计净值增长率	3.80%

注：(1)所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

(2)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	2.72%	0.52%	2.37%	0.55%	0.35%	-0.03%

过去三个月	1.84%	1.07%	1.21%	1.04%	0.63%	0.03%
过去六个月	2.49%	0.97%	0.07%	0.97%	2.42%	0.00%
过去一年	12.79%	1.30%	13.12%	1.32%	-0.33%	-0.02%
自基金合同生效起至今	3.80%	1.03%	2.88%	1.04%	0.92%	-0.01%

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



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

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

财通基金管理有限公司（下称“财通基金”）经中国证监会批准，于2011年6月正式成立。目前公司拥有公募基金管理、特定客户资产管理、QDII、受托管理保险资金投资管理等业务资格。公司股东为财通证券股份有限公司、杭州市实业投资集团有限公司和浙江亨通控股股份有限公司，注册资本2亿元人民币，注册地上海。成立近14年来，公

司收获了“三大报”权威奖项（金牛奖+金基金奖+明星基金奖），先后荣获130余项业内权威大奖。

截至2025年6月末，财通基金合计管理规模约1,048.19亿元，其中，公募基金管理规模约747.53亿元。公司以打造“特色鲜明、多元发展、客户信赖”的一流资产管理公司为企业愿景，坚持多元化业务布局，旗下公募基金覆盖股票、混合、债券、指数、货币等完整产品线，可满足不同类型客户的多元化需求。同时公司在专户业务中勇于突破，不断探索定增+、固收+、量化+等特色领域，努力以专业创造价值。

财通基金始终恪守“敬畏、感恩、专业、责任”的核心价值观，坚信投资研究是核心竞争力，为客户创造收益才是硬道理。公司以资产管理为核心，坚守初心、苦练内功，配备了一支专业投研团队，纵深一级半、二级市场，坚持为投资者创造价值。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
朱海东	量化投资部副总经理（主持工作）、本基金的基金经理	2019-07-16	-	13年	复旦大学基础数学硕士。历任银河基金管理有限公司量化研究员，平安资产管理有限责任公司研究经理。2019年6月加入财通基金管理有限公司，曾任量化投资部基金经理、总经理助理（主持工作），现任量化投资部副总经理（主持工作）、基金经理。
郭欣	本基金的基金经理	2024-03-08	-	11年	上海财经大学概率论与数理统计硕士。历任诺德基金管理有限公司研究员，上海翼丰投资管理有限公司量化研究员。2017年11月加入财通基金管理有限公司，曾任量化投资部研究员、投资

					经理助理、投资经理，现任 量化投资部基金经理。
--	--	--	--	--	----------------------------

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

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

(3)证券从业的含义遵从法律法规及行业协会的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾2025年上半年，尽管海外环境持续出现扰动，国内宏观经济依旧展现出较强的韧性和稳定性。我们认为上半年中国经济整体表现较好，主要亮点体现在两个方面：一是面对“对等关税”带来的外部压力，出口端呈现出一波“抢出口”式的集中释放，动能显

著；二是消费端增速超预期，得益于消费补贴政策以及“以旧换新”等措施逐步落地并开始显现效果。

从结构上看，经济运行仍呈现出两方面的分化特征：一方面，“供强需弱”的格局依旧延续，价格端缺乏足够弹性，企业利润修复仍需时间；另一方面，科技驱动型产业持续强劲表现，显示出经济对旧有增长引擎的依赖正在减弱，结构转型的步伐仍在推进中。

海外方面，美国经济虽然在结构层面有边际放缓的迹象，但整体经济依旧展现出一定的韧性。2025年4月实施的“对等关税”尚未对美国劳动力市场产生明显抑制，我们认为其对通胀的影响或将逐步显现，短期内冲击有限。美联储方面，政策制定者仍维持观望态度，暂未急于启动降息进程。总体来看，我们认为海外政策的不确定性依旧是当前宏观面临的主要风险之一，而全球经济增速是否会明显放缓仍需持续评估。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，财通沪深300指数增强基金份额净值为1.4905元，本报告期内，基金份额净值增长率为2.49%，同期业绩比较基准收益率为0.07%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，随着“对等关税”效应的逐步减退，市场可能将回归基本面主导的定价逻辑，全球经济也可能延续此前“软着陆”的预期节奏。在国内，除了加快培育“新质生产力”外，“扩大内需”或将仍是拉动经济增长的关键所在。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金完成转型后,《基金合同》约定:在符合有关基金分红条件的前提下,本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配,具体分配方案以公告为准。

本基金本报告期内未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内,中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定,对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督,未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求,各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《财通沪深300指数增强型证券投资基金2025年中期报告》进行了复核,认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等内容真实、准确。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：财通沪深300指数增强型证券投资基金

报告截止日：2025年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	23,214,053.21	33,456,938.13
结算备付金		4,454,266.41	14,757,317.36
存出保证金		1,260,597.60	2,252,966.40
交易性金融资产	6.4.7.2	293,951,946.37	404,392,006.20
其中：股票投资		293,951,946.37	404,392,006.20
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		977,479.83	948,560.95
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		323,858,343.42	455,807,789.04
负债和净资产	附注号	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024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		2,183,697.80	705,968.35
应付管理人报酬		342,069.37	468,386.47
应付托管费		57,011.56	78,064.40
应付销售服务费		-	-
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	91,330.26	166,272.79
负债合计		2,674,108.99	1,418,692.01
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	215,480,874.20	312,451,266.57
未分配利润	6.4.7.8	105,703,360.23	141,937,830.46
净资产合计		321,184,234.43	454,389,097.03
负债和净资产总计		323,858,343.42	455,807,789.04

注：报告截止日2025年06月30日，基金份额净值1.4905元，基金份额总额215,480,874.20份。

6.2 利润表

会计主体：财通沪深300指数增强型证券投资基金

本报告期：2025年01月01日至2025年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025年01月01日至 2025年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至202 4年06月30日
一、营业总收入		11,607,694.97	5,419,379.55
1.利息收入		123,752.38	192,262.20

其中：存款利息收入	6.4.7.9	123,752.38	192,262.20
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		7,428,305.09	1,151,097.34
其中：股票投资收益	6.4.7.10	2,082,231.82	1,050,030.21
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	5,970.44
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	703,221.23	-6,339,034.75
股利收益	6.4.7.13	4,642,852.04	6,434,131.44
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	4,048,491.65	4,025,478.19
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	7,145.85	50,541.82
减：二、营业总支出		2,878,920.16	3,967,305.25
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	2,367,879.90	3,330,219.42
2.托管费	6.4.10.2.2	394,646.66	555,036.59
3.销售服务费		-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-

6.信用减值损失	6.4.7.16	-	-
7.税金及附加		3,191.24	-
8.其他费用	6.4.7.17	113,202.36	82,049.24
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		8,728,774.81	1,452,074.30
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		8,728,774.81	1,452,074.30
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		8,728,774.81	1,452,074.30

6.3 净资产变动表

会计主体：财通沪深300指数增强型证券投资基金

本报告期：2025年01月01日至2025年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	312,451,266.57	141,937,830.46	454,389,097.03
二、本期期初净资产	312,451,266.57	141,937,830.46	454,389,097.03
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-96,970,392.37	-36,234,470.23	-133,204,862.60
（一）、综合收益总额	-	8,728,774.81	8,728,774.81
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-96,970,392.37	-44,963,245.04	-141,933,637.41

其中：1.基金申购款	83,094,835.53	37,022,201.93	120,117,037.46
2.基金赎回款	-180,065,227.90	-81,985,446.97	-262,050,674.87
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	215,480,874.20	105,703,360.23	321,184,234.43
项 目	上年度可比期间 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	454,173,798.54	137,678,039.13	591,851,837.67
二、本期期初净资产	454,173,798.54	137,678,039.13	591,851,837.67
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	7,193,206.71	10,655,038.28	17,848,244.99
（一）、综合收益总额	-	1,452,074.30	1,452,074.30
（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）	7,193,206.71	9,202,963.98	16,396,170.69
其中：1.基金申购款	345,765,639.78	122,121,848.67	467,887,488.45
2.基金赎回款	-338,572,433.07	-112,918,884.69	-451,491,317.76
（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	461,367,005.25	148,333,077.41	609,700,082.66

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

徐春庭	刘为臻	孙金
_____	_____	_____
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以标的指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。其他包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（含国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、股指期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《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“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

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财政部颁布的企业会计准则及附注6.4.2中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金2025年06月30日的财务状况、自2025年01月01日起至2025年06月30日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[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[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得

税政策的公告》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《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号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 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，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。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。

b) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）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。

d) 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。自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

e) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

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 2025年06月30日
活期存款	1,180,576.35
等于：本金	1,180,232.27
加：应计利息	344.08
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	22,033,476.86
等于：本金	22,033,061.76
加：应计利息	415.10
减：坏账准备	-
合计	23,214,053.21

注：其他存款期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	287,668,374.21	-	293,951,946.37	6,283,572.16
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		287,668,374.21	-	293,951,946.37	6,283,572.16

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025年06月30日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	10,409,496.00	-	-	-
--股指期货	10,409,496.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	10,409,496.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IF2507	IF2507	6.00	7,034,040.00	118,464.00
IF2512	IF2512	3.00	3,470,940.00	-22,980.00
合计				95,484.00
减：可抵销 期货暂收款				95,484.00
净额				-

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

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	81,822.86
其他应付	9,507.40
合计	91,330.26

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
----	-------------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	312,451,266.57	312,451,266.57
本期申购	83,094,835.53	83,094,835.53
本期赎回（以“-”号填列）	-180,065,227.90	-180,065,227.90
本期末	215,480,874.20	215,480,874.20

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	131,795,656.82	10,142,173.64	141,937,830.46
本期期初	131,795,656.82	10,142,173.64	141,937,830.46
本期利润	4,680,283.16	4,048,491.65	8,728,774.81
本期基金份额交易产生的变动数	-40,339,970.97	-4,623,274.07	-44,963,245.04
其中：基金申购款	34,426,034.23	2,596,167.70	37,022,201.93
基金赎回款	-74,766,005.20	-7,219,441.77	-81,985,446.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	96,135,969.01	9,567,391.22	105,703,360.23

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
活期存款利息收入	22,341.68
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	14,769.25
结算备付金利息收入	86,641.38
其他	0.07
合计	123,752.38

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 2025年01月01日至2025年06月30日
卖出股票成交总额	975,071,600.99
减：卖出股票成本总额	972,036,577.63
减：交易费用	952,791.54
买卖股票差价收入	2,082,231.82

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期末有债券投资收益项目。

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期末有买卖债券差价收入。

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末有债券赎回差价收入。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末有债券申购差价收入。

6.4.7.12 衍生工具收益

6.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益--买卖权证差价收入。

6.4.7.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
期货投资	703,221.23

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
股票投资产生的股利收益	4,642,852.04
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	4,642,852.04

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
1.交易性金融资产	4,160,367.65
——股票投资	4,160,367.65
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-111,876.00
——权证投资	-
——期货投资	-111,876.00
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	4,048,491.65

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
基金赎回费收入	4,147.90
转换费收入	2,997.95

合计	7,145.85
----	----------

6.4.7.16 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
审计费用	22,315.49
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	31,379.50
合计	113,202.36

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
财通基金管理有限公司（“财通基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
财通证券股份有限公司（“财通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
中国光大银行股份有限公司（“光大银行”）	基金托管人、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至20 25年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至20 24年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,367,879.90	3,330,219.42
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,042,337.92	1,972,295.73
应支付基金管理人的净管理费	1,325,541.98	1,357,923.69

注：(1)支付基金管理人的基金管理费按前一日基金资产净值的1.20%年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付；

(2)基金管理费计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.20%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025	上年度可比期间 2024年01月01日至2024
----	------------------------	-----------------------------

	年06月30日	年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	394,646.66	555,036.59

注：(1)支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值的0.20%年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付；

(2)基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况
无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况
无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2025年01月01日至2025年06月30日		2024年01月01日至2024年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
光大银行	1,180,576.35	22,341.68	46,172,572.07	70,257.86

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项的说明。

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

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

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2025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
688411	海博思创	2025-01-20	6个月	新股限售	19.38	83.49	560	10,852.80	46,754.40	-
688775	影石创新	2025-06-04	6个月	新股限售	47.27	124.16	265	12,526.55	32,902.40	-
688545	兴福电子	2025-01-15	6个月	新股限售	11.68	26.95	994	11,609.92	26,788.30	-
301458	钧崴电子	2025-01-02	6个月	新股限售	10.40	34.11	701	7,290.40	23,911.11	-
688583	思看科技	2025-01-08	6个月	新股限售	33.46	79.68	175	5,855.50	13,944.00	-
688583	思看科技	2025-06-19	1个月内（含）	新股限售	-	79.68	52	-	4,143.36	-

				-送 股						
3016 78	新恒 汇	2025 -06-1 3	6个月	新股 限售	12.80	44.54	382	4,88 9.60	17,01 4.28	-
3016 02	超研 股份	2025 -01-1 5	6个月	新股 限售	6.70	24.80	658	4,40 8.60	16,31 8.40	-
3015 01	恒鑫 生活	2025 -03-1 1	6个月	新股 限售	39.92	45.22	241	9,62 0.72	10,89 8.02	-
3015 01	恒鑫 生活	2025 -06-0 6	1-6个月 (含)	新股 限售 -送 股	-	45.22	109	-	4,92 8.98	-
3014 79	弘景 光电	2025 -03-0 6	6个月	新股 限售	41.90	77.87	130	5,44 7.00	10,12 3.10	-
3014 79	弘景 光电	2025 -05-2 8	1-6个月 (含)	新股 限售 -送 股	-	77.87	52	-	4,04 9.24	-
3015 35	浙江 华远	2025 -03-1 8	6个月	新股 限售	4.92	18.99	734	3,61 1.28	13,93 8.66	-
6887 57	胜科 纳米	2025 -03-1 8	6个月	新股 限售	9.08	25.94	536	4,86 6.88	13,90 3.84	-
0013 88	信通 电子	2025 -06-2 4	1个月内 (含)	认购 新发 证券	16.42	16.42	843	13,84 2.06	13,84 2.06	-
6030 72	天和 磁材	2024 -12-2 4	6个月	新股 限售	12.30	54.45	226	2,77 9.80	12,30 5.70	-
3016 62	宏工 科技	2025 -04-1	6个月	新股 限售	26.60	82.50	143	3,80 3.80	11,79 7.50	-

		0								
301601	惠通科技	2025-01-08	6个月	新股限售	11.80	33.85	342	4,035.60	11,576.70	-
001356	富岭股份	2025-01-16	6个月	新股限售	5.30	14.44	709	3,757.70	10,237.96	-
301590	优优绿能	2025-05-28	6个月	新股限售	89.60	139.48	73	6,540.80	10,182.04	-
301658	首航新能	2025-03-26	6个月	新股限售	11.80	22.98	437	5,156.60	10,042.26	-
688755	汉邦科技	2025-05-09	6个月	新股限售	22.77	39.33	203	4,622.31	7,983.99	-
301173	毓恬冠佳	2025-02-24	6个月	新股限售	28.33	44.98	173	4,901.09	7,781.54	-
001382	新亚电缆	2025-03-13	6个月	新股限售	7.40	20.21	366	2,708.40	7,396.86	-
603014	威高血净	2025-05-12	6个月	新股限售	26.50	32.68	173	4,584.50	5,653.64	-
301560	众捷汽车	2025-04-17	6个月	新股限售	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-
603202	天有为	2025-04-16	6个月	新股限售	93.50	90.66	53	4,955.50	4,804.98	-
603210	泰鸿万立	2025-04-01	6个月	新股限售	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	-
603124	江南新材	2025-03-12	6个月	新股限售	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-

603409	汇通控股	2025-02-25	6个月	新股限售	24.18	33.32	100	2,418.00	3,332.00	-
001390	古麒绒材	2025-05-21	6个月	新股限售	12.08	18.12	178	2,150.24	3,225.36	-
603257	中国瑞林	2025-03-28	6个月	新股限售	20.52	37.47	78	1,600.56	2,922.66	-
603400	华之杰	2025-06-12	6个月	新股限售	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
603382	海阳科技	2025-06-05	6个月	新股限售	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-
001335	信凯科技	2025-04-02	6个月	新股限售	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-
603120	肯特催化	2025-04-09	6个月	新股限售	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-
001388	信通电子	2025-06-24	6个月	新股限售	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688313	仕佳光	2025-06-30	重大事	38.05	2025-07-11	39.98	30,900	775,238.54	1,175,745.00	-

	子		项							
--	---	--	---	--	--	--	--	--	--	--

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

于2025年06月30日，本基金未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于2025年06月30日，本基金未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的管理人进行风险管理的主要目标是加强对投资风险防范和控制，保证基金资产的安全，维护基金份额持有人的利益；同时，提升基金投资组合的风险调整后收益水平，将以上各种风险控制在限定的范围之内，在基金的风险和收益之间取得最佳的平衡，实现“风险和收益相匹配”的投资目标，谋求基金资产的长期稳定增长。

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，

确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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建立了信用风险管理流程，通过对各类投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估，建立相应的分级别的交易对手库，并分别限定交易额度，同时采取一定的风险缓释措施。本基金的银行存款存放在本基金的托管人光大银行，还有部分存款存放在开立于本基金的结算机构国泰海通证券、广发证券和中信证券华南股份有限公司的证券账户内，按银行同业利率计息，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式、对手授信额度、价格偏离等方面进行限制以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025年06月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	23,214,053.21	-	-	-	-	-	23,214,053.21
结算备付金	1,364.17	-	-	-	-	4,452,902.24	4,454,266.41

存出 保证 金	1,260,597.60	-	-	-	-	-	1,260,597.60
交易 性金 融资 产	-	-	-	-	-	293,951,946.3 7	293,951,946.3 7
应收 申购 款	-	-	-	-	-	977,479.83	977,479.83
资产 总计	24,476,014.9 8	-	-	-	-	299,382,328.4 4	323,858,343.4 2
负债							
应付 赎回 款	-	-	-	-	-	2,183,697.80	2,183,697.80
应付 管理 人报 酬	-	-	-	-	-	342,069.37	342,069.37
应付 托管 费	-	-	-	-	-	57,011.56	57,011.56
其他 负债	-	-	-	-	-	91,330.26	91,330.26
负债 总计	-	-	-	-	-	2,674,108.99	2,674,108.99
利率 敏感 度缺 口	24,476,014.9 8	-	-	-	-	296,708,219.4 5	321,184,234.4 3
上年 度末	1个月以内	1-3个月	3个月-1 年	1-5年	5年以上	不计息	合计

2024 年12 月31 日							
资产							
货币 资金	33,456,938.13	-	-	-	-	-	33,456,938.13
结算 备付 金	14,757,317.36	-	-	-	-	-	14,757,317.36
存出 保证 金	2,252,966.40	-	-	-	-	-	2,252,966.40
交易 性金 融资 产	-	-	-	-	-	404,392,006.20	404,392,006.20
应收 申购 款	-	-	-	-	-	948,560.95	948,560.95
资产 总计	50,467,221.89	-	-	-	-	405,340,567.15	455,807,789.04
负债							
应付 赎回 款	-	-	-	-	-	705,968.35	705,968.35
应付 管理 人报 酬	-	-	-	-	-	468,386.47	468,386.47
应付 托管 费	-	-	-	-	-	78,064.40	78,064.40

其他 负债	-	-	-	-	-	166,272.79	166,272.79
负债 总计	-	-	-	-	-	1,418,692.01	1,418,692.01
利率 敏感 度缺 口	50,467,221.8 9	-	-	-	-	403,921,875.1 4	454,389,097.0 3

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025年06月30日		上年度末 2024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	293,951,946.37	91.52	404,392,006.20	89.00
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	293,951,946.37	91.52	404,392,006.20	89.00

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.基金的市场价格风险决定于基金相对其业绩比较基准的贝塔系数，以及业绩比较基准的变动。		
	2.除业绩比较基准变动外，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
	3.贝塔系数的估计以过去一年的历史数据作为样本，采用线性回归法估计。		
	4.业绩比较基准的变动对基金的净值表现具有对称性影响。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
	业绩比较基准增加1%	3,150,393.82	4,484,486.69

	业绩比较基准减少1%	-3,150,393.82	-4,484,486.69
--	------------	---------------	---------------

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	292,388,934.24	402,096,332.94
第二层次	1,191,130.54	27,736.50
第三层次	371,881.59	2,267,936.76
合计	293,951,946.37	404,392,006.20

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。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2025年06月30日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2024年12月31日：无)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于2025年06月30日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	293,951,946.37	90.77
	其中：股票	293,951,946.37	90.77
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	27,668,319.62	8.54
8	其他各项资产	2,238,077.43	0.69
9	合计	323,858,343.42	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	756,180.00	0.24
B	采矿业	9,400,427.04	2.93

C	制造业	127,099,587.12	39.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,994,997.68	4.05
E	建筑业	3,756,088.00	1.17
F	批发和零售业	401,284.00	0.12
G	交通运输、仓储和邮政业	4,443,211.80	1.38
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,038,739.70	4.68
J	金融业	58,921,051.06	18.34
K	房地产业	1,338,292.00	0.42
L	租赁和商务服务业	3,616,777.72	1.13
M	科学研究和技术服务业	2,492,367.00	0.78
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	2,813,878.08	0.88
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	243,072,881.20	75.68

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	560,046.00	0.17
C	制造业	23,409,793.80	7.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,826,440.00	1.19
E	建筑业	5,819.00	0.00

F	批发和零售业	3,235,448.10	1.01
G	交通运输、仓储和邮政业	3,457,296.00	1.08
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,355,226.15	1.36
J	金融业	10,158,696.60	3.16
K	房地产业	472,164.32	0.15
L	租赁和商务服务业	1,148.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	431,117.20	0.13
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	1,490.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	964,380.00	0.30
S	综合	-	-
	合计	50,879,065.17	15.84

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通机制投资的港股。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	34,200	8,625,924.00	2.69
2	600519	贵州茅台	6,115	8,619,214.80	2.68
3	600036	招商银行	120,400	5,532,380.00	1.72
4	600919	江苏银行	459,451	5,485,844.94	1.71

5	600900	长江电力	167,900	5,060,506.00	1.58
6	000333	美的集团	64,545	4,660,149.00	1.45
7	601318	中国平安	81,400	4,516,072.00	1.41
8	000651	格力电器	97,021	4,358,183.32	1.36
9	600690	海尔智家	168,100	4,165,518.00	1.30
10	000001	平安银行	334,200	4,033,794.00	1.26
11	600031	三一重工	222,481	3,993,533.95	1.24
12	688111	金山办公	14,149	3,962,427.45	1.23
13	000858	五粮液	31,810	3,782,209.00	1.18
14	601916	浙商银行	1,067,900	3,620,181.00	1.13
15	000725	京东方A	887,100	3,539,529.00	1.10
16	300274	阳光电源	51,740	3,506,419.80	1.09
17	002415	海康威视	119,200	3,305,416.00	1.03
18	601899	紫金矿业	162,599	3,170,680.50	0.99
19	688256	寒武纪	5,202	3,129,003.00	0.97
20	601166	兴业银行	128,500	2,999,190.00	0.93
21	300015	爱尔眼科	225,471	2,813,878.08	0.88
22	600276	恒瑞医药	54,000	2,802,600.00	0.87
23	601211	国泰海通	143,500	2,749,460.00	0.86
24	300059	东方财富	118,600	2,743,218.00	0.85
25	300760	迈瑞医疗	11,717	2,633,395.75	0.82
26	000100	TCL科技	571,900	2,476,327.00	0.77
27	601888	中国中免	40,546	2,472,089.62	0.77
28	002594	比亚迪	7,200	2,389,752.00	0.74
29	600000	浦发银行	169,600	2,354,048.00	0.73
30	601012	隆基绿能	153,983	2,312,824.66	0.72
31	600886	国投电力	156,300	2,303,862.00	0.72
32	000568	泸州老窖	20,316	2,303,834.40	0.72
33	002230	科大讯飞	47,300	2,264,724.00	0.71
34	600674	川投能源	139,800	2,242,392.00	0.70
35	600309	万华化学	38,933	2,112,504.58	0.66

36	688981	中芯国际	22,952	2,023,677.84	0.63
37	600050	中国联通	371,100	1,981,674.00	0.62
38	601728	中国电信	250,500	1,941,375.00	0.60
39	601229	上海银行	181,100	1,921,471.00	0.60
40	002371	北方华创	4,300	1,901,503.00	0.59
41	600660	福耀玻璃	32,500	1,852,825.00	0.58
42	603259	药明康德	26,100	1,815,255.00	0.57
43	601857	中国石油	201,100	1,719,405.00	0.54
44	002142	宁波银行	61,915	1,693,994.40	0.53
45	688008	澜起科技	20,591	1,688,462.00	0.53
46	601288	农业银行	278,200	1,635,816.00	0.51
47	601919	中远海控	107,400	1,615,296.00	0.50
48	600887	伊利股份	57,100	1,591,948.00	0.50
49	601766	中国中车	208,967	1,471,127.68	0.46
50	002736	国信证券	126,100	1,452,672.00	0.45
51	600176	中国巨石	127,171	1,449,749.40	0.45
52	600011	华能国际	202,000	1,442,280.00	0.45
53	002463	沪电股份	32,900	1,400,882.00	0.44
54	000425	徐工机械	177,700	1,380,729.00	0.43
55	601328	交通银行	170,100	1,360,800.00	0.42
56	600160	巨化股份	47,400	1,359,432.00	0.42
57	688041	海光信息	9,579	1,353,416.91	0.42
58	601988	中国银行	238,800	1,342,056.00	0.42
59	601398	工商银行	176,300	1,338,117.00	0.42
60	300014	亿纬锂能	28,900	1,323,909.00	0.41
61	603288	海天味业	33,600	1,307,376.00	0.41
62	000166	申万宏源	256,900	1,289,638.00	0.40
63	000338	潍柴动力	81,900	1,259,622.00	0.39
64	300408	三环集团	36,500	1,219,100.00	0.38
65	002311	海大集团	20,800	1,218,672.00	0.38
66	600460	士兰微	46,400	1,151,648.00	0.36

67	600019	宝钢股份	174,300	1,148,637.00	0.36
68	000975	山金国际	59,100	1,119,354.00	0.35
69	601009	南京银行	95,400	1,108,548.00	0.35
70	601138	工业富联	50,900	1,088,242.00	0.34
71	603501	豪威集团	8,345	1,065,239.25	0.33
72	000538	云南白药	19,000	1,060,010.00	0.33
73	000063	中兴通讯	32,200	1,046,178.00	0.33
74	000938	紫光股份	43,400	1,041,166.00	0.32
75	601995	中金公司	29,000	1,025,440.00	0.32
76	600219	南山铝业	267,100	1,022,993.00	0.32
77	002001	新和成	46,860	996,712.20	0.31
78	000999	华润三九	31,780	994,078.40	0.31
79	600482	中国动力	42,500	980,475.00	0.31
80	600183	生益科技	31,700	955,755.00	0.30
81	000157	中联重科	131,700	952,191.00	0.30
82	601169	北京银行	138,000	942,540.00	0.29
83	688012	中微公司	4,877	889,077.10	0.28
84	601319	中国人保	101,800	886,678.00	0.28
85	600941	中国移动	7,700	866,635.00	0.27
86	002352	顺丰控股	17,700	863,052.00	0.27
87	605117	德业股份	15,712	827,393.92	0.26
88	000776	广发证券	49,100	825,371.00	0.26
89	603986	兆易创新	6,500	822,445.00	0.26
90	601117	中国化学	103,800	796,146.00	0.25
91	600926	杭州银行	46,600	783,812.00	0.24
92	600415	小商品城	37,400	773,432.00	0.24
93	002714	牧原股份	18,000	756,180.00	0.24
94	601688	华泰证券	42,000	748,020.00	0.23
95	002916	深南电路	6,790	732,029.90	0.23
96	601628	中国人寿	16,800	691,992.00	0.22
97	601377	兴业证券	108,400	670,996.00	0.21

98	600346	恒力石化	46,800	667,368.00	0.21
99	600048	保利发展	79,800	646,380.00	0.20
100	601881	中国银河	37,562	644,188.30	0.20
101	600016	民生银行	134,900	640,775.00	0.20
102	601225	陕西煤业	33,000	634,920.00	0.20
103	600332	白云山	24,000	632,640.00	0.20
104	600989	宝丰能源	39,000	629,460.00	0.20
105	600406	国电南瑞	27,061	606,437.01	0.19
106	601088	中国神华	14,900	604,046.00	0.19
107	601601	中国太保	16,100	603,911.00	0.19
108	002074	国轩高科	18,300	594,018.00	0.18
109	600027	华电国际	106,600	583,102.00	0.18
110	300782	卓胜微	8,140	580,951.80	0.18
111	002129	TCL中环	75,400	579,072.00	0.18
112	601668	中国建筑	99,600	574,692.00	0.18
113	601669	中国电建	115,400	561,998.00	0.17
114	000408	藏格矿业	13,000	554,710.00	0.17
115	601006	大秦铁路	82,300	543,180.00	0.17
116	600030	中信证券	18,800	519,256.00	0.16
117	300394	天孚通信	6,440	514,169.60	0.16
118	601066	中信建投	20,700	497,835.00	0.15
119	688036	传音控股	6,172	491,908.40	0.15
120	001979	招商蛇口	55,000	482,350.00	0.15
121	601816	京沪高铁	83,800	481,850.00	0.15
122	600584	长电科技	14,300	481,767.00	0.15
123	000895	双汇发展	19,600	478,436.00	0.15
124	002648	卫星化学	27,100	469,643.00	0.15
125	600741	华域汽车	26,600	469,490.00	0.15
126	600089	特变电工	38,943	464,589.99	0.14
127	601800	中国交建	51,800	460,502.00	0.14
128	600104	上汽集团	28,600	459,030.00	0.14

129	601618	中国中冶	153,600	457,728.00	0.14
130	600585	海螺水泥	21,300	457,311.00	0.14
131	000807	云铝股份	28,600	457,028.00	0.14
132	600958	东方证券	46,800	453,024.00	0.14
133	600438	通威股份	26,900	450,575.00	0.14
134	603993	洛阳钼业	53,500	450,470.00	0.14
135	002920	德赛西威	4,400	449,372.00	0.14
136	002049	紫光国微	6,800	447,848.00	0.14
137	002236	大华股份	28,200	447,816.00	0.14
138	601390	中国中铁	78,900	442,629.00	0.14
139	300896	爱美客	2,500	437,025.00	0.14
140	601985	中国核电	46,574	434,069.68	0.14
141	600188	兖矿能源	34,862	424,270.54	0.13
142	000596	古井贡酒	3,100	412,765.00	0.13
143	300999	金龙鱼	13,710	404,856.30	0.13
144	600600	青岛啤酒	5,744	398,978.24	0.12
145	002601	龙佰集团	24,100	390,661.00	0.12
146	600025	华能水电	40,800	389,640.00	0.12
147	601111	中国国航	48,400	381,876.00	0.12
148	600018	上港集团	66,700	380,857.00	0.12
149	002709	天赐材料	20,600	373,272.00	0.12
150	600196	复星医药	14,800	371,332.00	0.12
151	002027	分众传媒	50,857	371,256.10	0.12
152	300347	泰格医药	6,900	367,908.00	0.11
153	000625	长安汽车	28,800	367,488.00	0.11
154	600803	新奥股份	19,400	366,660.00	0.11
155	601868	中国能建	154,800	345,204.00	0.11
156	601077	渝农商行	47,800	341,292.00	0.11
157	601898	中煤能源	31,100	340,234.00	0.11
158	600436	片仔癀	1,700	340,017.00	0.11
159	601939	建设银行	34,400	324,736.00	0.10

160	300661	圣邦股份	4,380	318,732.60	0.10
161	688126	沪硅产业	16,664	311,950.08	0.10
162	601633	长城汽车	14,500	311,460.00	0.10
163	300759	康龙化成	12,600	309,204.00	0.10
164	600938	中国海油	11,800	308,098.00	0.10
165	601607	上海医药	16,800	300,384.00	0.09
166	600809	山西汾酒	1,700	299,863.00	0.09
167	002304	洋河股份	4,600	296,930.00	0.09
168	300122	智飞生物	14,400	282,096.00	0.09
169	603019	中科曙光	4,000	281,600.00	0.09
170	688396	华润微	5,770	272,113.20	0.08
171	600028	中国石化	43,400	244,776.00	0.08
172	600150	中国船舶	7,500	244,050.00	0.08
173	688047	龙芯中科	1,800	240,102.00	0.07
174	601838	成都银行	11,900	239,190.00	0.07
175	603799	华友钴业	6,400	236,928.00	0.07
176	688599	天合光能	15,478	224,895.34	0.07
177	601336	新华保险	3,800	222,300.00	0.07
178	300124	汇川技术	3,236	208,948.52	0.07
179	688223	晶科能源	39,996	207,579.24	0.06
180	601658	邮储银行	37,300	204,031.00	0.06
181	000786	北新建材	7,500	198,600.00	0.06
182	002459	晶澳科技	19,800	197,604.00	0.06
183	605499	东鹏饮料	620	194,711.00	0.06
184	601825	沪农商行	18,700	181,390.00	0.06
185	300316	晶盛机电	6,400	173,760.00	0.05
186	600760	中航沈飞	2,900	169,998.00	0.05
187	600547	山东黄金	5,300	169,229.00	0.05
188	688303	大全能源	6,880	146,681.60	0.05
189	002179	中航光电	3,600	145,296.00	0.05
190	000002	万科A	22,000	141,240.00	0.04

191	000708	中信特钢	11,683	137,392.08	0.04
192	688472	阿特斯	14,917	136,490.55	0.04
193	603806	福斯特	10,360	134,265.60	0.04
194	600489	中金黄金	9,000	131,670.00	0.04
195	002028	思源电气	1,800	131,238.00	0.04
196	688187	时代电气	2,890	123,258.50	0.04
197	600010	包钢股份	68,200	122,078.00	0.04
198	000768	中航西飞	4,300	117,562.00	0.04
199	601058	赛轮轮胎	8,800	115,456.00	0.04
200	601901	方正证券	14,200	112,322.00	0.03
201	600362	江西铜业	4,700	110,121.00	0.03
202	688082	盛美上海	965	109,952.10	0.03
203	600426	华鲁恒升	5,000	108,350.00	0.03
204	000963	华东医药	2,500	100,900.00	0.03
205	000617	中油资本	13,200	96,360.00	0.03
206	300442	润泽科技	1,900	94,107.00	0.03
207	300418	昆仑万维	2,700	90,801.00	0.03
208	600015	华夏银行	11,162	88,291.42	0.03
209	600795	国电电力	16,000	77,440.00	0.02
210	600515	海南机场	19,300	68,322.00	0.02
211	601186	中国铁建	8,500	68,085.00	0.02
212	000876	新希望	7,000	65,660.00	0.02
213	300832	新产业	1,100	62,392.00	0.02
214	600845	宝信软件	2,452	57,916.24	0.02
215	600066	宇通客车	2,300	57,178.00	0.02
216	003816	中国广核	14,900	54,236.00	0.02
217	601799	星宇股份	400	50,000.00	0.02
218	601877	正泰电器	2,200	49,874.00	0.02
219	600039	四川路桥	4,960	49,104.00	0.02
220	001965	招商公路	3,800	45,600.00	0.01
221	603833	欧派家居	800	45,160.00	0.01

222	600026	中远海能	4,300	44,419.00	0.01
223	300413	芒果超媒	2,000	43,640.00	0.01
224	600023	浙能电力	7,700	40,810.00	0.01
225	600377	宁沪高速	2,500	38,350.00	0.01
226	601872	招商轮船	6,000	37,560.00	0.01
227	000983	山西焦煤	5,300	33,920.00	0.01
228	601808	中海油服	1,900	26,144.00	0.01
229	601699	潞安环能	2,200	23,210.00	0.01
230	000661	长春高新	164	16,265.52	0.01
231	001391	国货航	1,660	11,171.80	0.00
232	002475	立讯精密	100	3,469.00	0.00
233	601689	拓普集团	40	1,890.00	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	603323	苏农银行	539,520	3,026,707.20	0.94
2	002807	江阴银行	631,900	3,001,525.00	0.93
3	002839	张家港行	651,100	2,929,950.00	0.91
4	000791	甘肃能源	367,900	2,347,202.00	0.73
5	688313	仕佳光子	30,900	1,175,745.00	0.37
6	603173	福斯达	28,600	1,016,730.00	0.32
7	603605	珀莱雅	11,900	985,201.00	0.31
8	600685	中船防务	35,900	976,121.00	0.30
9	601083	锦江航运	84,700	941,017.00	0.29
10	300973	立高食品	19,200	936,384.00	0.29
11	001389	广合科技	15,700	922,689.00	0.29
12	301078	孩子王	70,300	918,821.00	0.29
13	688112	鼎阳科技	24,381	901,365.57	0.28

14	605599	菜百股份	54,200	886,170.00	0.28
15	002734	利民股份	47,700	872,910.00	0.27
16	002315	焦点科技	19,100	872,679.00	0.27
17	688685	迈信林	15,482	864,669.70	0.27
18	600757	长江传媒	92,400	857,472.00	0.27
19	601298	青岛港	97,800	849,882.00	0.26
20	601665	齐鲁银行	134,200	848,144.00	0.26
21	600694	大商股份	45,180	838,089.00	0.26
22	600012	皖通高速	49,300	837,114.00	0.26
23	603816	顾家家居	32,400	826,848.00	0.26
24	001872	招商港口	41,600	826,176.00	0.26
25	300824	北鼎股份	67,600	806,468.00	0.25
26	603236	移远通信	9,300	797,940.00	0.25
27	002668	TCL智家	81,200	793,324.00	0.25
28	603379	三美股份	16,300	784,356.00	0.24
29	600578	京能电力	166,800	748,932.00	0.23
30	688258	卓易信息	15,200	736,136.00	0.23
31	601991	大唐发电	229,300	726,881.00	0.23
32	600885	宏发股份	32,300	720,613.00	0.22
33	600703	三安光电	56,800	705,456.00	0.22
34	300724	捷佳伟创	12,400	673,320.00	0.21
35	688188	柏楚电子	5,080	668,832.80	0.21
36	600073	光明肉业	81,000	597,780.00	0.19
37	688692	达梦数据	2,388	532,261.32	0.17
38	603233	大参林	31,000	505,300.00	0.16
39	688508	芯朋微	9,000	502,380.00	0.16
40	603267	鸿远电子	9,000	452,430.00	0.14
41	688018	乐鑫科技	3,070	448,527.00	0.14
42	002293	罗莱生活	50,900	444,866.00	0.14
43	002555	三七互娱	25,100	433,979.00	0.14
44	301230	泓博医药	11,700	402,714.00	0.13

45	002597	金禾实业	16,700	393,285.00	0.12
46	605305	中际联合	14,100	391,698.00	0.12
47	002299	圣农发展	24,600	351,534.00	0.11
48	002812	恩捷股份	12,000	351,480.00	0.11
49	002595	豪迈科技	5,900	349,398.00	0.11
50	603979	金诚信	7,400	343,656.00	0.11
51	600062	华润双鹤	17,400	324,684.00	0.10
52	688278	特宝生物	4,500	324,495.00	0.10
53	600282	南钢股份	76,800	322,560.00	0.10
54	300888	稳健医疗	7,700	316,470.00	0.10
55	002078	太阳纸业	23,500	316,310.00	0.10
56	002271	东方雨虹	28,640	307,307.20	0.10
57	600801	华新水泥	24,300	287,712.00	0.09
58	002745	木林森	33,200	261,616.00	0.08
59	688617	惠泰医疗	870	258,390.00	0.08
60	000528	柳工	26,600	255,626.00	0.08
61	600007	中国国贸	12,100	249,018.00	0.08
62	688475	萤石网络	7,767	244,815.84	0.08
63	002543	万和电气	21,400	237,754.00	0.07
64	600398	海澜之家	29,300	203,928.00	0.06
65	601997	贵阳银行	28,800	179,712.00	0.06
66	688100	威胜信息	4,556	168,799.80	0.05
67	600383	金地集团	42,400	160,696.00	0.05
68	002517	恺英网络	7,300	140,963.00	0.04
69	600699	均胜电子	7,800	136,032.00	0.04
70	688002	睿创微纳	1,900	132,468.00	0.04
71	601918	新集能源	20,000	129,200.00	0.04
72	601928	凤凰传媒	9,300	103,881.00	0.03
73	600517	国网英大	19,700	100,470.00	0.03
74	603659	璞泰来	5,200	97,656.00	0.03
75	600968	海油发展	20,900	85,272.00	0.03

76	601311	骆驼股份	9,000	81,270.00	0.03
77	600273	嘉化能源	9,200	77,832.00	0.02
78	600873	梅花生物	7,200	76,968.00	0.02
79	603529	爱玛科技	2,000	68,800.00	0.02
80	603179	新泉股份	1,400	65,758.00	0.02
81	601963	重庆银行	5,800	62,988.00	0.02
82	688122	西部超导	1,100	57,068.00	0.02
83	600266	城建发展	11,600	52,664.00	0.02
84	600859	王府井	3,600	50,004.00	0.02
85	688411	海博思创	560	46,754.40	0.01
86	688775	影石创新	265	32,902.40	0.01
87	688545	兴福电子	994	26,788.30	0.01
88	301458	钧崴电子	701	23,911.11	0.01
89	688583	思看科技	227	18,087.36	0.01
90	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.01
91	301602	超研股份	658	16,318.40	0.01
92	301501	恒鑫生活	350	15,827.00	0.00
93	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
94	000050	深天马A	1,800	15,336.00	0.00
95	000967	盈峰环境	2,200	15,290.00	0.00
96	600729	重庆百货	500	14,915.00	0.00
97	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
98	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.00
99	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.00
100	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
101	600998	九州通	2,300	11,822.00	0.00
102	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
103	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.00
104	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00
105	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
106	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00

107	002532	天山铝业	1,200	9,972.00	0.00
108	301050	雷电微力	180	9,594.00	0.00
109	688578	艾力斯	102	9,490.08	0.00
110	003021	兆威机电	80	8,652.00	0.00
111	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
112	600862	中航高科	300	7,824.00	0.00
113	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
114	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
115	300803	指南针	90	7,259.40	0.00
116	688050	爱博医疗	99	6,816.15	0.00
117	688080	映翰通	125	6,361.25	0.00
118	603325	博隆技术	66	5,959.14	0.00
119	603014	威高血净	173	5,653.64	0.00
120	688408	中信博	118	5,508.24	0.00
121	600496	精工钢构	1,700	5,440.00	0.00
122	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
123	301606	绿联科技	96	4,937.28	0.00
124	301536	星宸科技	81	4,884.30	0.00
125	002014	永新股份	400	4,848.00	0.00
126	603202	天有为	53	4,804.98	0.00
127	600665	天地源	1,400	4,690.00	0.00
128	603031	安孚科技	153	4,527.27	0.00
129	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
130	688551	科威尔	151	4,437.89	0.00
131	688819	天能股份	159	4,413.84	0.00
132	688390	固德威	101	4,388.45	0.00
133	603194	中力股份	91	4,130.49	0.00
134	601155	新城控股	300	4,104.00	0.00
135	603082	北自科技	107	4,092.75	0.00
136	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
137	002536	飞龙股份	270	4,039.20	0.00

138	688612	威迈斯	148	3,957.52	0.00
139	600419	天润乳业	400	3,952.00	0.00
140	603391	力聚热能	100	3,906.00	0.00
141	301526	国际复材	1,055	3,840.20	0.00
142	688687	凯因科技	142	3,775.78	0.00
143	688510	航亚科技	155	3,747.90	0.00
144	688150	莱特光电	139	3,436.08	0.00
145	688707	振华新材	253	3,428.15	0.00
146	600116	三峡水利	500	3,425.00	0.00
147	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
148	002833	弘亚数控	200	3,272.00	0.00
149	603290	斯达半导	40	3,250.80	0.00
150	688363	华熙生物	63	3,235.05	0.00
151	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
152	301607	富特科技	80	3,193.60	0.00
153	000932	华菱钢铁	700	3,080.00	0.00
154	688719	爱科赛博	72	3,060.00	0.00
155	603466	风语筑	300	3,027.00	0.00
156	603310	巍华新材	154	2,947.56	0.00
157	688089	嘉必优	117	2,942.55	0.00
158	001308	康冠科技	130	2,940.60	0.00
159	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
160	688095	福昕软件	43	2,920.13	0.00
161	001358	兴欣新材	122	2,919.46	0.00
162	688691	灿芯股份	47	2,907.42	0.00
163	002495	佳隆股份	1,100	2,838.00	0.00
164	002139	拓邦股份	200	2,762.00	0.00
165	688777	中控技术	61	2,739.51	0.00
166	603341	龙旗科技	67	2,722.21	0.00
167	301571	国科天成	50	2,594.50	0.00
168	300638	广和通	90	2,576.70	0.00

169	301017	漱玉平民	200	2,566.00	0.00
170	688314	康拓医疗	83	2,563.04	0.00
171	600774	汉商集团	300	2,544.00	0.00
172	301585	蓝宇股份	73	2,503.90	0.00
173	603610	麒盛科技	200	2,498.00	0.00
174	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
175	688147	微导纳米	82	2,474.76	0.00
176	301578	辰奕智能	69	2,469.51	0.00
177	002955	鸿合科技	100	2,457.00	0.00
178	605167	利柏特	200	2,432.00	0.00
179	001387	雪祺电气	173	2,377.02	0.00
180	688029	南微医学	35	2,364.25	0.00
181	301235	华康洁净	100	2,364.00	0.00
182	603395	红四方	70	2,361.10	0.00
183	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
184	300682	朗新集团	100	2,350.00	0.00
185	688580	伟思医疗	50	2,324.50	0.00
186	002011	盾安环境	200	2,320.00	0.00
187	002820	桂发祥	200	2,318.00	0.00
188	688289	圣湘生物	113	2,314.24	0.00
189	603883	老百姓	110	2,311.10	0.00
190	300457	赢合科技	100	2,300.00	0.00
191	603757	大元泵业	100	2,278.00	0.00
192	002790	瑞尔特	312	2,268.24	0.00
193	002461	珠江啤酒	200	2,258.00	0.00
194	002895	川恒股份	100	2,256.00	0.00
195	002396	星网锐捷	100	2,245.00	0.00
196	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
197	600648	外高桥	200	2,186.00	0.00
198	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00
199	688589	力合微	101	2,160.39	0.00

200	688439	振华风光	37	2,155.25	0.00
201	300685	艾德生物	100	2,153.00	0.00
202	688076	诺泰生物	56	2,084.32	0.00
203	688556	高测股份	284	2,039.12	0.00
204	688389	普门科技	153	1,976.76	0.00
205	002430	杭氧股份	100	1,942.00	0.00
206	000762	西藏矿业	100	1,918.00	0.00
207	603215	比依股份	100	1,890.00	0.00
208	688639	华恒生物	58	1,838.60	0.00
209	003011	海象新材	100	1,837.00	0.00
210	688058	宝兰德	64	1,834.88	0.00
211	603055	台华新材	200	1,826.00	0.00
212	300532	今天国际	145	1,748.70	0.00
213	002928	华夏航空	200	1,662.00	0.00
214	002847	盐津铺子	20	1,608.00	0.00
215	002085	万丰奥威	100	1,589.00	0.00
216	002030	达安基因	260	1,573.00	0.00
217	002658	雪迪龙	200	1,566.00	0.00
218	688569	铁科轨道	75	1,545.00	0.00
219	301502	华阳智能	38	1,543.18	0.00
220	300036	超图软件	100	1,526.00	0.00
221	600197	伊力特	100	1,492.00	0.00
222	300244	迪安诊断	100	1,490.00	0.00
223	688709	成都华微	45	1,473.30	0.00
224	601231	环旭电子	100	1,463.00	0.00
225	601333	广深铁路	500	1,445.00	0.00
226	300729	乐歌股份	100	1,432.00	0.00
227	300681	英搏尔	50	1,383.00	0.00
228	001318	阳光乳业	100	1,319.00	0.00
229	300655	晶瑞电材	131	1,311.31	0.00
230	002405	四维图新	150	1,281.00	0.00

231	002507	涪陵榨菜	100	1,279.00	0.00
232	600908	无锡银行	200	1,262.00	0.00
233	301552	科力装备	32	1,240.32	0.00
234	603303	得邦照明	100	1,207.00	0.00
235	002258	利尔化学	109	1,203.36	0.00
236	301617	博苑股份	29	1,190.45	0.00
237	688106	金宏气体	66	1,180.74	0.00
238	603027	千禾味业	100	1,161.00	0.00
239	688276	百克生物	55	1,155.00	0.00
240	600826	兰生股份	140	1,148.00	0.00
241	002497	雅化集团	100	1,140.00	0.00
242	603312	西典新能	30	1,100.10	0.00
243	000957	中通客车	100	1,093.00	0.00
244	301588	美新科技	57	1,057.92	0.00
245	002478	常宝股份	200	1,050.00	0.00
246	002116	中国海诚	100	1,023.00	0.00
247	603708	家家悦	100	1,020.00	0.00
248	300705	九典制药	64	996.48	0.00
249	600663	陆家嘴	112	992.32	0.00
250	300619	金银河	26	732.16	0.00
251	301591	肯特股份	19	730.55	0.00
252	688530	欧莱新材	44	724.68	0.00
253	601187	厦门银行	100	679.00	0.00
254	603520	司太立	69	676.20	0.00
255	603421	鼎信通讯	100	673.00	0.00
256	002026	山东威达	50	607.50	0.00
257	688586	江航装备	52	585.00	0.00
258	603866	桃李面包	100	540.00	0.00
259	603002	宏昌电子	79	519.03	0.00
260	603556	海兴电力	19	483.93	0.00
261	000401	冀东水泥	100	438.00	0.00

262	688200	华峰测控	3	432.60	0.00
263	002442	龙星科技	61	389.18	0.00
264	688584	上海合晶	15	268.20	0.00
265	688698	伟创电气	3	141.60	0.00
266	600022	山东钢铁	100	130.00	0.00
267	301580	爱迪特	3	124.29	0.00
268	601096	宏盛华源	18	74.52	0.00
269	600792	云煤能源	17	62.56	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601009	南京银行	11,785,972.00	2.59
2	002839	张家港行	11,494,929.00	2.53
3	600919	江苏银行	10,820,119.76	2.38
4	300750	宁德时代	10,767,233.40	2.37
5	000001	平安银行	10,689,754.00	2.35
6	002807	江阴银行	10,452,390.00	2.30
7	600036	招商银行	9,743,841.00	2.14
8	600926	杭州银行	7,886,930.00	1.74
9	601728	中国电信	7,187,907.00	1.58
10	601318	中国平安	6,938,113.00	1.53
11	600030	中信证券	6,901,903.00	1.52
12	600886	国投电力	6,760,808.00	1.49
13	600690	海尔智家	6,644,362.00	1.46
14	000651	格力电器	6,424,216.00	1.41
15	601211	国泰海通	5,827,795.00	1.28
16	002594	比亚迪	5,736,457.00	1.26

17	000333	美的集团	5,352,927.05	1.18
18	603323	苏农银行	5,273,608.00	1.16
19	601398	工商银行	5,011,248.00	1.10
20	600519	贵州茅台	4,993,836.00	1.10

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002594	比亚迪	19,997,999.00	4.40
2	601872	招商轮船	13,821,764.60	3.04
3	601009	南京银行	10,984,679.80	2.42
4	002807	江阴银行	10,654,788.00	2.34
5	600926	杭州银行	10,496,403.44	2.31
6	601229	上海银行	10,461,293.00	2.30
7	000001	平安银行	10,135,668.00	2.23
8	300750	宁德时代	10,135,324.40	2.23
9	600919	江苏银行	10,095,744.00	2.22
10	600519	贵州茅台	9,981,336.90	2.20
11	600030	中信证券	9,961,057.80	2.19
12	600111	北方稀土	9,884,428.00	2.18
13	002839	张家港行	8,730,029.00	1.92
14	600900	长江电力	8,710,536.68	1.92
15	601318	中国平安	8,351,025.00	1.84
16	000333	美的集团	8,251,357.00	1.82
17	600036	招商银行	8,058,534.00	1.77
18	600690	海尔智家	6,865,975.00	1.51
19	300502	新易盛	6,690,521.00	1.47
20	601138	工业富联	6,660,045.00	1.47

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	857,436,150.15
卖出股票收入（成交）总额	975,071,600.99

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金暂不投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体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 报告期内，本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,260,597.60
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	977,479.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,238,077.43

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不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	688313	仕佳光子	1,175,745.00	0.37	停牌

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
6,544	32,928.01	24,206,027.11	11.23%	191,274,847.09	88.77%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	62,533.54	0.03%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2022年12月21日)基金份额总额	119,111,800.66
本报告期期初基金份额总额	312,451,266.57
本报告期基金总申购份额	83,094,835.53
减：本报告期基金总赎回份额	180,065,227.90
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	215,480,874.20

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

- 1、本报告期内，本基金管理人于2025年5月14日聘任刘江女士担任总经理助理职务。
- 2、2025年1月，中国光大银行股份有限公司聘任贾光华先生担任资产托管部总经理职务。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金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

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所，为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）。

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

措施1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2025年01月07日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证监会上海监管局
受到的具体措施类型	责令改正
受到稽查或处罚等措施的原因	部分业务管理不规范
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已完成整改
其他	无
措施2	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	高级管理人员

受到稽查或处罚等措施的时间	2025年01月07日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证监会上海监管局
受到的具体措施类型	警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	部分业务管理不规范
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已完成整改
其他	无

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰海通	2	619,772,653.65	33.85%	119,079.51	34.24%	-
广发证券	3	625,333,801.30	34.15%	116,246.92	33.42%	-
中信证券华南	3	585,957,926.56	32.00%	112,484.04	32.34%	-

注：1、选择证券公司参与证券交易的标准

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

- (1)经营行为规范、合规内控制度健全；
- (2)具备高效、安全运作的通讯条件和稳定的交易系统，满足基金投资交易需求；
- (3)具备良好的市场形象和财务状况；

- (4)具备较强的研究及综合服务能力，具有专门的研究机构和专职研究人员；
- (5)被动股票型基金选择合作券商原则上应优先考虑交易服务能力。

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

2、选择证券公司参与证券交易的程序

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	财通沪深300指数增强型证券投资基金2024年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2025-01-22
2	财通沪深300指数增强型证券投资基金2024年年度报告	中国证监会规定媒介	2025-03-29
3	财通基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024年度）	中国证监会规定媒介	2025-03-31
4	财通沪深300指数增强型证券投资基金2025年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2025-04-22
5	关于民商基金销售（上海）有限公司终止代理销售财通	中国证监会规定媒介	2025-05-30

	基金管理有限公司旗下基金的公告		
6	财通沪深300指数增强型证券投资基金更新招募说明书（2025年06月27日公告）	中国证监会规定媒介	2025-06-27
7	财通沪深300指数增强型证券投资基金基金产品资料概要更新（2025年06月27日公告）	中国证监会规定媒介	2025-06-27

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

12.2 存放地点

上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心43、45楼。

12.3 查阅方式

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

咨询电话：400-820-9888

公司网址：www.ctfund.com

财通基金管理有限公司
二〇二五年八月三十日