

汇泉中证 A500 指数量化增强型证券投资基金
2026 年中期报告
2026 年 06 月 30 日

基金管理人:汇泉基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2026 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
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	11
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	15
§ 7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	34
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
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	44
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	44
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	44
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	45
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	45
7.11 投资组合报告附注	45
§ 8 基金份额持有人信息	46

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
8.2 盈利投资者数量占比.....	46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	47
8.4 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.....	47
§ 9 开放式基金份额变动.....	47
§ 10 重大事件揭示.....	48
10.1 基金份额持有人大会决议.....	48
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.....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
10.4 基金投资策略的改变.....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	48
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况.....	49
10.8 其他重大事件.....	49
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	50
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.....	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	50
§ 12 备查文件目录.....	50
12.1 备查文件目录.....	50
12.2 存放地点.....	50
12.3 查阅方式.....	50

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇泉中证 A500 指数量化增强型证券投资基金	
基金简称	汇泉中证 A500 指数量化增强	
基金主代码	025276	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 09 月 24 日	
基金管理人	汇泉基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	51,240,639.32 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇泉中证 A500 指数量化增强 A	汇泉中证 A500 指数量化增强 C
下属分级基金的交易代码	025276	025277
报告期末下属分级基金的份 额总额	33,646,185.73 份	17,594,453.59 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过量化模型及基本面分析进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金的投资策略主要包括：1、股票投资策略；2、存托凭证投资策略；3、债券投资策略；4、可转换债券和可交换债券投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、衍生品投资策略；7、参与融资及转融通证券出借业务策略。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金是一只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。同时，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。 本基金除了投资 A 股以外，还可以投资港股通标的股票，会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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇泉基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负 责人	姓名	张强	任航
	联系电话	010-81925261	010-66060069

	电子邮箱	zhangqiang@springsfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-001-5252、010-81925252	95599
传真		010-81925299	010-68121816
注册地址		北京市通州区贡院街 1 号院 1 号楼二层 206-40 室	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		北京市海淀区西直门外大街 168 号腾达大厦 16 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		100044	100031
法定代表人		孟朝霞	谷澍

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
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.springsfund.com
基金中期报告置备地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	汇泉基金管理有限公司	北京市海淀区西直门外大街 168 号腾达大厦 16 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2026 年 01 月 01 日-2026 年 06 月 30 日）	
	汇泉中证 A500 指数量化增强 A	汇泉中证 A500 指数量化增强 C
本期已实现收益	8,615,597.11	2,797,108.17
本期利润	10,200,363.52	3,115,413.56
加权平均基金份额本期利润	0.1464	0.1337
本期加权平均净值利润率	13.85%	12.61%
本期基金份额净值增长率	12.03%	11.89%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
期末可供分配利润	4,218,214.45	2,168,733.32
期末可供分配基金份额利润	0.1254	0.1233
期末基金资产净值	38,565,367.68	20,128,740.51
期末基金份额净值	1.1462	1.1440
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	14.62%	14.40%

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

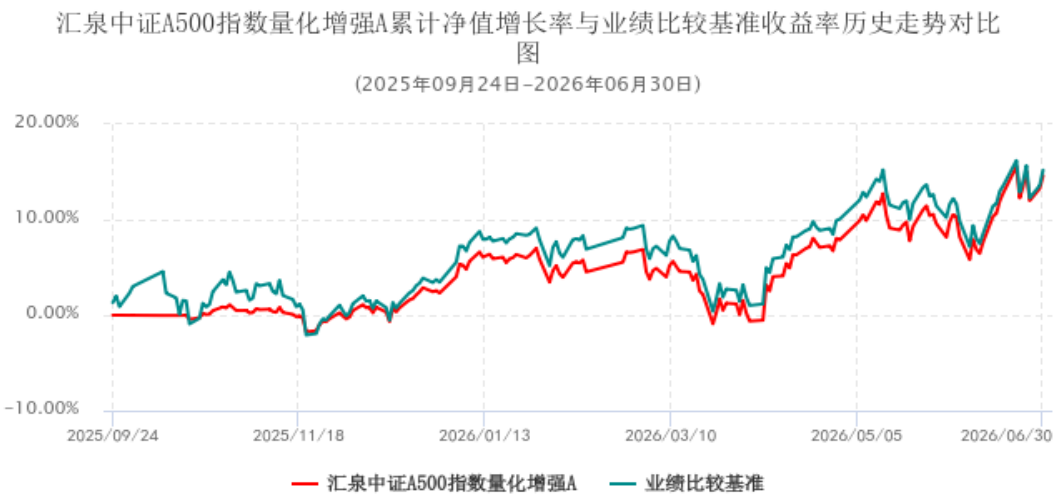
汇泉中证 A500 指数量化增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	14.57%	1.32%	13.54%	1.34%	1.03%	-0.02%
过去六个月	12.03%	1.16%	11.34%	1.22%	0.69%	-0.06%
自基金合同生效起至今	14.62%	0.96%	15.19%	1.15%	-0.57%	-0.19%

汇泉中证 A500 指数量化增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	14.50%	1.32%	13.54%	1.34%	0.96%	-0.02%
过去六个月	11.89%	1.16%	11.34%	1.22%	0.55%	-0.06%
自基金合同生效起至今	14.40%	0.96%	15.19%	1.15%	-0.79%	-0.19%

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



汇泉中证A500指数量化增强C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2025年09月24日-2026年06月30日)



注：1、本基金合同于 2025 年 9 月 24 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年；
2、按照本基金合同和招募说明书的约定，自基金成立日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例符合约定。

§ 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

汇泉基金管理有限公司（以下简称“我公司”）经中国证券监督管理委员会证监许可【2020】1028 号文批准，于 2020 年 6 月 15 日在北京市注册成立，注册资本 10468 万元人民币。并于 2020 年 12 月 21 日取得中国证券监督管理委员会核发的《经营证券期货业务许可证》。我公司目前股东及其出资比例为：杨宇先生 52.83%，梁永强先生 29.61%，孟朝霞女士 2.01%，柴功先生 1.51%，北京溪泉企业管理中心（有限合伙）4.68%，上海澹泉企业管理中心（有限合伙）4.68%，上海沛泉企业管理中心（有限合伙）4.68%。

截至本报告期末，我公司共管理 14 只公募基金，具体包括汇泉策略优选混合型证券投资基金、汇泉臻心致远混合型证券投资基金、汇泉兴至未来一年持有期混合型证券投资基金、汇泉安盈回报债券型证券投资基金、汇泉匠心智选一年持有期混合型证券投资基金、汇泉启元未来混合型发起式证券投资基金、汇泉中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、汇泉安阳纯债债券型证券投资基金、汇泉智享量化选股混合型证券投资基金、汇泉均衡智选混合型证券投资基金、汇泉安瑞回报债券型证券投资基金、汇泉中证 A500 指数量化增强型证券投资基金、汇泉安悦 90 天持有期债券型证券投资基金、汇泉科创创业量化选股混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨宇	本基金的基金经理兼任投资经理、首席量化投资官	2025-09-24	—	27 年	中国国籍，硕士研究生，具有基金从业资格。曾任万家（天同）基金管理有限公司投资管理部总经理，金贝塔网络金融科技（深圳）有限公司联席 CEO，嘉实基金管理有限公司董事总经理、指数及量化首席投资官、基金经理。现任汇泉基金管理有限公司首席量化投资官、基金经理兼任投资经理。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
杨宇	公募基金	5	196,695,958.51	2022-09-13
	私募资产管理计划	1	21,865,930.91	2025-08-08
	其他组合	—	—	—
	合计	6	218,561,889.42	—

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

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》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善

相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和私募资产管理计划等投资组合。

公司于每季度、每年度对旗下管理的不同投资组合的整体收益率、分投资类别（股票、债券）的收益率进行分析，对连续四个季度期间内不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内、10 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为，公平交易制度的整体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，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的 5% 的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，A 股市场震荡分化、风格轮动较快，中小盘结构性特征显著，中证 A500 指数涵盖优质中盘标的，估值合理、交易活跃，具备较好的量化增强基础。本基金为中证 A500 量化指数增强产品，以中证 A500 指数为跟踪基准，在严控跟踪误差、保持组合行业与市值风格贴合基准的前提下，通过成熟量化模型开展主动增强，力争获取稳健超额收益。

运作上，本基金坚持“指数为本、量化增强”的策略框架，底仓紧密对标指数成份股，广泛覆盖先进制造、科技成长、高端装备等细分领域优质中盘企业。A500 成份股多为细分行业龙头，成长性与分散度较好、系统性风险较低，适配量化选股运作。报告期内，基金严格控制行业、风格及个股权重偏离，杜绝风格漂移，保证组合走势贴合基准。

增强层面，本基金依托多因子模型、风控体系与智能交易系统开展精细化管理。选股端整合价值、成长、质量、动量等核心因子，通过数据回测与动态迭代，优选基本面稳健、估值合理的优质个股，优化持仓结构。同时严格监控行业集中度、因子波动及个股风险，动态调整模型参数，有效控制组合回撤与波动。

展望后续，本基金将继续坚守中证 A500 指数增强策略，持续优化量化模型与风控体系，紧跟中小盘风格变化，在严控跟踪误差与组合风险的前提下，挖掘中盘个股结构性机会，力争为持有人创造持续稳定的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末汇泉中证 A500 指数量化增强 A 基金份额净值为 1.1462 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 12.03%，同期业绩比较基准收益率为 11.34%；截至报告期末汇泉中证 A500 指数量化增强 C 基金份额净值为 1.1440 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 11.89%，同期业绩比较基准收益率为 11.34%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026 年上半年，宏观经济延续“稳中有进、向新向优”的态势，GDP 同比增长 4.7%，高技术制造业增加值增长 13.3%，新动能对经济增长贡献率超四成。展望下半年，稳增长政策有望进一步聚焦内需，货币政策预计维持适度宽松。

证券市场方面，上半年科技板块成为绝对主线，科创 50 上涨约 54%，电子、通信涨幅分别达 86%和 74%，而全市场下跌个股占比近七成，结构分化极端。7 月以来科技板块明显回调，市场正从板块集中走向风格再平衡。对于以中证 A500 指数为代表的细分行业龙头领域，我们重点关注以下几点：

1. 新质生产力的均衡载体

中证 A500 指数通过“先分层、再选龙、后配平”的编制机制，广泛覆盖 89 个中证三级行业，新兴行业权重提升至 59.28%。指数成分股 2026 年一季度归母净利润同比增速达 12.7%，盈利质量与成长确定性正获得市场重估。这些细分龙头是发展“新质生产力”的主力军，直接受益于科技创新与产业升级的政策红利。

2. 风格再平衡中的估值修复机遇

经历 7 月调整后，中证 A500 指数 PE 约 17.4 倍，股权风险溢价约 4.0%，意味着相对于无风险利率，估值并未高企。在科技板块交易拥挤度已达历史高位的背景下，市场风格有望向更加均衡的方向修复。A500 指数中大量传统行业优质公司的估值吸引力将逐步凸显。

3. 量化增强策略的优势发挥

本基金采用量化增强策略，在中证 A500 指数基准上，通过多因子选股模型系统性地挖掘超额收益。区别于传统指数基金被动跟踪，量化增强能够在指数成分内主动超配具有更高盈利质量、更强动量趋势和更低估值偏离度的个股，同时利用均值回归策略捕捉短期定价偏差带来的交易性机会。在风格切换与结构分化加剧的市场环境中，多因子模型的系统性扫描能力能够有效识别不同行业、不同风格维度下的优质标的，避免主观判断的局限性。此外，量化策略严格的风险预算管理与纪律化的再平衡机制，有助于在控制跟踪误差和下行风险的前提下，持续积累超额收益。

本基金将继续秉持“纪律、系统、迭代”的投资理念，不断精进量化投研体系，在严格管控风险的前提下，力求为持有人创造可持续的超额回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

本基金管理人设有估值委员会，负责对估值政策和程序进行定期评价和适时调整，指导和监督估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备基金估值运作、行业研究、风险管理和法律合规等领域的专业胜任能力。基金经理参与估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务。

本报告期内，本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国农业银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）在本基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对本基金的投资运作情况进行了必要的监督，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支、利润分配等方面进行了复核，未发现基金管理人有关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

本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，以自身能够获取的数据和信息为限，对本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行核查，以上内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：汇泉中证 A500 指数量化增强型证券投资基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	6,154,853.15	24,440,193.12
结算备付金		44,525.82	261,600.14
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	52,785,444.38	230,211,758.51
其中：股票投资		51,782,592.15	184,734,587.00
基金投资		-	-
债券投资		1,002,852.23	45,477,171.51
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		45,119.30	2,004.75
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		59,029,942.65	254,915,556.52
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产 款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		192,773.15	11,099,699.42
应付管理人报酬		36,583.14	213,295.40
应付托管费		6,859.32	39,992.89
应付销售服务费		3,435.24	13,121.81

应付投资顾问费		-	-
应交税费		81.65	38,028.52
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	96,101.96	74,275.00
负债合计		335,834.46	11,478,413.04
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	51,240,639.32	237,967,324.84
未分配利润	6.4.7.8	7,453,468.87	5,469,818.64
净资产合计		58,694,108.19	243,437,143.48
负债和净资产总计		59,029,942.65	254,915,556.52

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 51,240,639.32 份。其中汇泉中证 A500 指数量化增强 A 基金份额净值 1.1462 元，基金份额总额 33,646,185.73 份；汇泉中证 A500 指数量化增强 C 基金份额净值 1.1440 元，基金份额总额 17,594,453.59 份。

6.2 利润表

会计主体：汇泉中证 A500 指数量化增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
一、营业总收入		13,922,044.74
1. 利息收入		5,343.28
其中：存款利息收入	6.4.7.9	5,343.28
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）		12,012,421.76
其中：股票投资收益	6.4.7.10	11,430,994.07
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	-2,051.72
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-
衍生工具收益	6.4.7.14	37,825.82
股利收益	6.4.7.15	545,653.59
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	1,903,071.80
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,207.90

减：二、营业总支出		606,267.66
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	399,227.35
2. 托管费	6.4.10.2.2	74,855.13
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	31,073.87
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失		-
7. 税金及附加		623.27
8. 其他费用	6.4.7.18	100,488.04
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		13,315,777.08
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		13,315,777.08
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		13,315,777.08

6.3 净资产变动表

会计主体：汇泉中证 A500 指数量化增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	237,967,324.84	5,469,818.64	243,437,143.48
二、本期期初净资产	237,967,324.84	5,469,818.64	243,437,143.48
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-186,726,685.52	1,983,650.23	-184,743,035.29
（一）、综合收益总额	-	13,315,777.08	13,315,777.08
（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）	-186,726,685.52	-11,332,126.85	-198,058,812.37
其中：1. 基金申购款	13,682,842.61	1,240,215.09	14,923,057.70
2. 基金赎回款	-200,409,528.13	-12,572,341.94	-212,981,870.07
（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	51,240,639.32	7,453,468.87	58,694,108.19

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：

梁永强	陈磊	陈磊
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇泉中证 A500 指数量化增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2025]535 号《关于准予汇泉中证 A500 指数量化增强型证券投资基金注册的批复》注册,由汇泉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《汇泉中证 A500 指数量化增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集 368,906,553.70 元,业经容诚验字[2025]200Z0145 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《汇泉中证 A500 指数量化增强型证券投资基金基金合同》于 2025 年 9 月 25 日正式生效。基金合同生效日的基金份额总额为 369,043,778.24 份基金份额,其中认购资金利息折合 137,224.54 份基金份额。本基金的基金管理人为汇泉基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《汇泉中证 A500 指数量化增强型证券投资基金招募说明书》,本基金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,并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类基金资产中计提销售服务费,并不收取认购/申购费用的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金两类基金份额分别设置代码,分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇泉中证 A500 指数量化增强型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括中证 A500 指数的成份股及其备选成份股(均含存托凭证,下同),其他非标的指数成份股(包含主板、创业板及其他国内依法发行或上市的股票、存托凭证)、港股通标的股票、债券(国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券(含分离交易可转债的纯债部分)、可交换公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、金融衍生工具(包括股指期货、国债期货、股票期权)、货币市场工具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)。本基金可根据法律法规的规定参与融资业务。在条件许可的情况下,本基金可根据相关法律法规,在履行适当程序后,参与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,并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。本基金以标的指数成份股及备选成份股为主要投资对象。股票资产投资比例不低于基金资产的 80%,投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%;其中,投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低

于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证 A500 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》《证券投资基金会计核算业务指引》、本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 2026 年度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 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期所采用的会计政策和会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会关于上

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]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[2017]56 号《财政部、税务总局关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《财政部、税务总局关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《财政部 税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。2027 年 12 月 31 日前，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

2027 年 12 月 31 日前，对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

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。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。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。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
活期存款	2,891,853.21
等于：本金	2,891,522.20
加：应计利息	331.01
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	3,262,999.94
等于：本金	3,262,956.36
加：应计利息	43.58
减：坏账准备	-
合计	6,154,853.15

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 06 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		46,131,980.80	-	51,782,592.15	5,650,611.35
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	982,938.89	26,652.23	1,002,852.23	-6,738.89
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	982,938.89	26,652.23	1,002,852.23	-6,738.89
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		47,114,919.69	26,652.23	52,785,444.38	5,643,872.46

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

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
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	91,122.86
其他应付	4,979.10
合计	96,101.96

6.4.7.7 实收基金

汇泉中证 A500 指数量化增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	195,974,010.36	195,974,010.36
本期申购	6,570,780.20	6,570,780.20
本期赎回（以“-”号填列）	-168,898,604.83	-168,898,604.83
本期末	33,646,185.73	33,646,185.73

汇泉中证 A500 指数量化增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	41,993,314.48	41,993,314.48
本期申购	7,112,062.41	7,112,062.41
本期赎回（以“-”号填列）	-31,510,923.30	-31,510,923.30
本期末	17,594,453.59	17,594,453.59

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

汇泉中证 A500 指数量化增强 A

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	2,860,028.44	1,668,234.15	4,528,262.59
本期期初	2,860,028.44	1,668,234.15	4,528,262.59
本期利润	8,615,597.11	1,584,766.41	10,200,363.52
本期基金份额交易产生的变动数	-7,257,411.10	-2,552,033.06	-9,809,444.16
其中：基金申购款	450,013.01	-5,121.99	444,891.02
基金赎回款	-7,707,424.11	-2,546,911.07	-10,254,335.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,218,214.45	700,967.50	4,919,181.95

汇泉中证 A500 指数量化增强 C

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	584,221.97	357,334.08	941,556.05
本期期初	584,221.97	357,334.08	941,556.05
本期利润	2,797,108.17	318,305.39	3,115,413.56
本期基金份额交易产生的变动数	-1,212,596.82	-310,085.87	-1,522,682.69
其中：基金申购款	824,965.51	-29,641.44	795,324.07
基金赎回款	-2,037,562.33	-280,444.43	-2,318,006.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,168,733.32	365,553.60	2,534,286.92

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	1,363.27
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	3,019.57
结算备付金利息收入	960.44
其他	-
合计	5,343.28

注：其他存款利息收入所列金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的利息收入。

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	260,948,704.30
减：卖出股票成本总额	249,291,370.01
减：交易费用	226,340.22
买卖股票差价收入	11,430,994.07

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

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	135,119.47
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-137,171.19
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	-2,051.72

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	55,026,508.14
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	54,344,766.38
减：应计利息总额	817,594.51

减：交易费用	1,318.44
买卖债券差价收入	-137,171.19

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.13 贵金属投资收益

无。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股指期货投资收益	39,120.00
减：其他衍生工具收益应缴纳增值税	1,139.42
减：交易费用	154.76
合计	37,825.82

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	545,653.59
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	545,653.59

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	1,903,071.80
——股票投资	1,885,560.76
——债券投资	17,511.04
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-

——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	1,903,071.80

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	1,207.90
合计	1,207.90

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 25%归入基金资产。

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的赎回费的 25%归入转出基金的基金资产。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
审计费用	22,315.49
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	60.00
账户维护费	18,600.00
存托服务费	5.18
合计	100,488.04

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，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

关联方名称	与本基金的关系
汇泉基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(“农业银行”)	基金托管人、基金销售机构
杨宇	基金管理人股东
梁永强	基金管理人股东
孟朝霞	基金管理人股东
柴功	基金管理人股东
上海沛泉企业管理中心(有限合伙)	基金管理人股东
上海澹泉企业管理中心(有限合伙)	基金管理人股东
北京溪泉企业管理中心(有限合伙)	基金管理人股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	399,227.35
其中：应支付销售机构的客户维护费	199,375.82
应支付基金管理人的净管理费	199,851.53

注：支付基金管理人汇泉基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.80% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	74,855.13

注：支付基金托管人农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15%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×0.15% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方 名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇泉中证 A500 指数量化 增强 A	汇泉中证 A500 指数量化 增强 C	合计
农业银行	-	15,265.33	15,265.33
汇泉基金管理有限公司	-	0.69	0.69
合计	-	15,266.02	15,266.02

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人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 类基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
农业银行	2,891,853.21	1,363.27

注：本基金的银行存款由基金托管人农业银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

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

无。

6.4.12 期末（2026 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688785	恒运昌	2026 年 01 月 20 日	6 个月	科创板新股限售	92.18	463.15	70	6,452.60	32,420.50	-
601112	振石股份	2026 年 01 月 21 日	6 个月	股票流通受限	11.18	17.59	255	2,850.90	4,485.45	-

		日								
6.4.12.1.2 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
113704	春风转债	2026 年 06 月 10 日	19 个交易日	新债未上市	100.00	100.00	40	4,000.00	4,000.18	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026-06-29	重大事项停牌	879.53	2026-07-13	890.99	1,000	444,575.13	879,530.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是股票指数增强型基金，预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常投资管理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。本基金可投资港股通标的股票，会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

包括港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导合规风控工作。

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农业银行，其他存款存放于中信证券股份有限公司

、金融街证券股份有限公司，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

无。

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 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	-	17,277,525.48
AAA 以下	4,000.18	28,199,646.03
未评级	998,852.05	-
合计	1,002,852.23	45,477,171.51

注：未评级债券包含剩余期限大于一年的未有第三方机构评级的企业发行的债券。

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 2026 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 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、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的

可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 10%。于本报告期末，本基金持有流动性受限资产的比例符合上述要求。

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。

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债券投资。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	6,154,853.15	-	-	-	6,154,853.15
结算备付金	44,525.82	-	-	-	44,525.82
交易性金融 资产	-	998,852.05	4,000.18	51,782,592.15	52,785,444.38

应收申购款	-	-	-	45,119.30	45,119.30
资产总计	6,199,378.97	998,852.05	4,000.18	51,827,711.45	59,029,942.65
负债					
应付赎回款	-	-	-	192,773.15	192,773.15
应付管理人 报酬	-	-	-	36,583.14	36,583.14
应付托管费	-	-	-	6,859.32	6,859.32
应付销售服 务费	-	-	-	3,435.24	3,435.24
应交税费	-	-	-	81.65	81.65
其他负债	-	-	-	96,101.96	96,101.96
负债总计	-	-	-	335,834.46	335,834.46
利率敏感度 缺口	6,199,378.97	998,852.05	4,000.18	51,491,876.99	58,694,108.19
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	24,440,193.12	-	-	-	24,440,193.12
结算备付金	261,600.14	-	-	-	261,600.14
交易性金融 资产	3,029,552.05	42,447,619.46	-	184,734,587.00	230,211,758.51
应收申购款	-	-	-	2,004.75	2,004.75
资产总计	27,731,345.31	42,447,619.46	-	184,736,591.75	254,915,556.52
负债					
应付赎回款	-	-	-	11,099,699.42	11,099,699.42
应付管理人 报酬	-	-	-	213,295.40	213,295.40
应付托管费	-	-	-	39,992.89	39,992.89
应付销售服 务费	-	-	-	13,121.81	13,121.81
应交税费	-	-	-	38,028.52	38,028.52
其他负债	-	-	-	74,275.00	74,275.00
负债总计	-	-	-	11,478,413.04	11,478,413.04
利率敏感度 缺口	27,731,345.31	42,447,619.46	-	173,258,178.71	243,437,143.48

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券投资公允价值占基金净资产的比例为 1.71%（2025 年 12 月 31 日：18.68%），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影

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，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过量化模型及基本面分析进行积极的指数组合管理与风险控制。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金以标的指数成份股及备选成份股为主要投资对象。股票资产投资比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；其中，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。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，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	51,782,592.15	88.22	184,734,587.00	75.89
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	1,002,852.23	1.71	—	—
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	52,785,444.38	89.93	184,734,587.00	75.89

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 A500 指数收益率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 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	1. 中证 A500 指数收益率上升 5%	2,633,976.86	3,895,177.84
	2. 中证 A500 指数收益率下降 5%	-2,633,976.86	-3,895,177.84

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	50,866,156.20	184,467,256.00
第二层次	1,882,382.23	45,744,502.51
第三层次	36,905.95	-
合计	52,785,444.38	230,211,758.51

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。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

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
无。

§ 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	51,782,592.15	87.72
	其中：股票	51,782,592.15	87.72
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,002,852.23	1.70
	其中：债券	1,002,852.23	1.70
	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	6,199,378.97	10.50
8	其他各项资产	45,119.30	0.08
9	合计	59,029,942.65	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	10,497.00	0.02
B	采矿业	2,184,220.00	3.72
C	制造业	33,246,038.40	56.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,089,378.00	1.86
E	建筑业	615,102.00	1.05
F	批发和零售业	275,502.00	0.47
G	交通运输、仓储和邮政业	1,119,155.00	1.91
H	住宿和餐饮业	25,186.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,695,689.80	4.59
J	金融业	4,454,189.00	7.59
K	房地产业	63,075.00	0.11
L	租赁和商务服务业	294,278.00	0.50
M	科学研究和技术服务业	790,961.00	1.35

N	水利、环境和公共设施管理业	77,912.00	0.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	30,060.00	0.05
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	26,864.00	0.05
	合计	46,998,107.20	80.07

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	136,752.00	0.23
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,363,811.95	5.73
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	437,878.00	0.75
J	金融业	653,742.00	1.11
K	房地产业	62,978.00	0.11
L	租赁和商务服务业	89,003.00	0.15
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	40,320.00	0.07
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,784,484.95	8.15

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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	占基金资产净值比例(%)
1	300308	中际旭创	2,100	2,667,000.00	4.54

2	300750	宁德时代	4,700	1,847,147.00	3.15
3	603986	兆易创新	1,800	1,467,000.00	2.50
4	600519	贵州茅台	1,100	1,304,039.00	2.22
5	300502	新易盛	1,960	1,189,720.00	2.03
6	688256	寒武纪	596	950,947.80	1.62
7	688012	中微公司	2,014	943,559.00	1.61
8	601318	中国平安	19,600	935,704.00	1.59
9	688072	拓荆科技	1,000	879,530.00	1.50
10	601899	紫金矿业	32,800	824,592.00	1.40
11	600183	生益科技	4,300	745,620.00	1.27
12	603259	药明康德	5,500	684,805.00	1.17
13	600900	长江电力	25,700	680,279.00	1.16
14	600487	亨通光电	6,200	677,908.00	1.15
15	000988	华工科技	3,500	646,135.00	1.10
16	002384	东山精密	2,300	603,405.00	1.03
17	601166	兴业银行	36,300	601,128.00	1.02
18	002463	沪电股份	3,800	580,640.00	0.99
19	688498	源杰科技	290	546,940.00	0.93
20	002475	立讯精密	7,700	542,080.00	0.92
21	601398	工商银行	74,500	526,715.00	0.90
22	600036	招商银行	14,500	514,750.00	0.88
23	600549	厦门钨业	5,900	502,680.00	0.86
24	688525	佰维存储	1,000	494,730.00	0.84
25	002594	比亚迪	6,000	478,200.00	0.81
26	600276	恒瑞医药	8,800	457,952.00	0.78
27	300223	北京君正	1,800	448,020.00	0.76
28	600030	中信证券	15,200	436,696.00	0.74
29	000651	格力电器	11,400	427,500.00	0.73
30	601328	交通银行	65,300	419,879.00	0.72
31	000333	美的集团	5,500	415,415.00	0.71
32	600309	万华化学	5,600	383,096.00	0.65
33	688041	海光信息	1,000	370,300.00	0.63
34	002415	海康威视	10,700	365,940.00	0.62
35	002371	北方华创	400	353,824.00	0.60
36	301308	江波龙	500	351,900.00	0.60
37	601088	中国神华	8,900	347,456.00	0.59
38	002028	思源电气	2,000	346,000.00	0.59
39	600150	中国船舶	10,200	344,658.00	0.59
40	600031	三一重工	19,700	340,416.00	0.58
41	600000	浦发银行	39,300	338,373.00	0.58
42	601816	京沪高铁	71,800	325,254.00	0.55
43	688008	澜起科技	1,000	309,900.00	0.53
44	688266	泽璟制药	2,600	303,316.00	0.52

45	000792	盐湖股份	10,000	301,900.00	0.51
46	600406	国电南瑞	13,200	301,620.00	0.51
47	688111	金山办公	1,400	298,270.00	0.51
48	600887	伊利股份	12,200	292,312.00	0.50
49	601857	中国石油	33,500	290,780.00	0.50
50	688981	中芯国际	1,800	285,876.00	0.49
51	600660	福耀玻璃	5,500	277,420.00	0.47
52	300476	胜宏科技	800	277,144.00	0.47
53	300857	协创数据	800	271,920.00	0.46
54	688120	华海清科	840	270,631.20	0.46
55	605117	德业股份	2,540	269,697.20	0.46
56	600176	中国巨石	3,700	269,656.00	0.46
57	601872	招商轮船	15,300	268,821.00	0.46
58	600050	中国联通	64,300	257,200.00	0.44
59	688017	绿的谐波	600	250,716.00	0.43
60	601668	中国建筑	57,300	248,682.00	0.42
61	000338	潍柴动力	9,100	247,975.00	0.42
62	600795	国电电力	52,000	242,840.00	0.41
63	000100	TCL 科技	40,300	234,546.00	0.40
64	600893	航发动力	6,000	230,040.00	0.39
65	002156	通富微电	3,000	227,610.00	0.39
66	688521	芯原股份	600	222,684.00	0.38
67	300059	东方财富	10,800	220,104.00	0.38
68	002138	顺络电子	2,900	211,990.00	0.36
69	000933	神火股份	9,400	199,280.00	0.34
70	300033	同花顺	820	197,620.00	0.34
71	000807	云铝股份	8,900	197,046.00	0.34
72	600489	中金黄金	10,900	196,745.00	0.34
73	601117	中国化学	26,700	196,245.00	0.33
74	601012	隆基绿能	14,900	195,488.00	0.33
75	002185	华天科技	8,300	185,173.00	0.32
76	002851	麦格米特	1,100	183,898.00	0.31
77	603799	华友钴业	3,800	183,388.00	0.31
78	000858	五粮液	2,400	177,600.00	0.30
79	000538	云南白药	3,700	175,269.00	0.30
80	300604	长川科技	500	170,710.00	0.29
81	002352	顺丰控股	5,300	165,678.00	0.28
82	600221	海航控股	120,000	162,000.00	0.28
83	300037	新宙邦	1,700	157,845.00	0.27
84	600028	中国石化	34,700	154,762.00	0.26
85	002050	三花智控	3,400	149,022.00	0.25
86	300274	阳光电源	900	143,118.00	0.24
87	002129	TCL 中环	11,600	139,432.00	0.24

88	000960	锡业股份	3,200	136,608.00	0.23
89	002558	巨人网络	4,800	132,288.00	0.23
90	600885	宏发股份	3,700	127,613.00	0.22
91	601127	赛力斯	2,000	122,500.00	0.21
92	300760	迈瑞医疗	900	122,247.00	0.21
93	002008	大族激光	800	120,088.00	0.20
94	002027	分众传媒	24,700	119,548.00	0.20
95	000733	振华科技	2,100	118,944.00	0.20
96	002625	光启技术	3,900	118,248.00	0.20
97	601727	上海电气	16,800	117,600.00	0.20
98	600089	特变电工	5,200	117,000.00	0.20
99	000426	兴业银锡	3,500	115,360.00	0.20
100	601211	国泰海通	6,300	114,660.00	0.20
101	300024	机器人	5,800	112,114.00	0.19
102	601601	中国太保	3,900	111,228.00	0.19
103	300450	先导智能	2,700	109,944.00	0.19
104	000725	京东方 A	12,600	109,368.00	0.19
105	002472	双环传动	2,600	107,926.00	0.18
106	300136	信维通信	900	107,325.00	0.18
107	600096	云天化	3,500	106,400.00	0.18
108	002738	中矿资源	1,800	106,182.00	0.18
109	600580	卧龙电驱	3,200	105,920.00	0.18
110	002281	光迅科技	400	102,776.00	0.18
111	600352	浙江龙盛	8,300	100,513.00	0.17
112	601888	中国中免	1,800	96,678.00	0.16
113	002230	科大讯飞	2,300	93,932.00	0.16
114	603659	璞泰来	3,200	92,576.00	0.16
115	002353	杰瑞股份	600	91,500.00	0.16
116	300475	香农芯创	300	90,000.00	0.15
117	300142	沃森生物	6,900	89,631.00	0.15
118	002595	豪迈科技	1,910	89,006.00	0.15
119	002155	湖南黄金	3,700	88,319.00	0.15
120	603288	海天味业	2,600	86,216.00	0.15
121	600941	中国移动	1,000	86,130.00	0.15
122	688065	凯赛生物	1,800	86,130.00	0.15
123	300394	天孚通信	280	84,750.40	0.14
124	300474	景嘉微	1,400	84,672.00	0.14
125	002465	海格通信	6,500	83,005.00	0.14
126	000032	深桑达 A	3,300	82,335.00	0.14
127	002389	航天彩虹	4,600	81,742.00	0.14
128	603129	春风动力	300	76,740.00	0.13
129	688599	天合光能	5,400	76,248.00	0.13
130	600529	山东药玻	4,100	75,645.00	0.13

131	603019	中科曙光	700	75,061.00	0.13
132	300699	光威复材	2,600	74,490.00	0.13
133	002065	东华软件	10,400	74,256.00	0.13
134	000034	神州数码	2,660	73,815.00	0.13
135	600332	白云山	3,600	72,144.00	0.12
136	002085	万丰奥威	6,500	72,085.00	0.12
137	300073	当升科技	1,500	72,060.00	0.12
138	601111	中国国航	11,900	71,995.00	0.12
139	000738	航发控制	3,900	71,331.00	0.12
140	002049	紫光国微	800	71,000.00	0.12
141	601168	西部矿业	2,600	70,564.00	0.12
142	300676	华大基因	2,000	70,120.00	0.12
143	300919	中伟新材	1,600	70,000.00	0.12
144	600418	江淮汽车	2,700	69,741.00	0.12
145	600989	宝丰能源	3,400	69,122.00	0.12
146	600008	首创环保	25,400	69,088.00	0.12
147	002271	东方雨虹	5,800	68,846.00	0.12
148	600765	中航重机	5,200	67,184.00	0.11
149	603993	洛阳钼业	3,800	66,690.00	0.11
150	000887	中鼎股份	3,700	66,193.00	0.11
151	002405	四维图新	10,000	64,700.00	0.11
152	600585	海螺水泥	3,700	62,715.00	0.11
153	688777	中控技术	500	58,750.00	0.10
154	000630	铜陵有色	9,200	58,512.00	0.10
155	002007	华兰生物	4,800	58,512.00	0.10
156	002195	岩山科技	8,800	57,552.00	0.10
157	600516	方大炭素	9,000	55,530.00	0.09
158	600522	中天科技	900	54,612.00	0.09
159	600157	永泰能源	33,900	54,579.00	0.09
160	002241	歌尔股份	2,400	54,072.00	0.09
161	600196	复星医药	2,400	53,928.00	0.09
162	601155	新城控股	5,200	53,352.00	0.09
163	601390	中国中铁	12,600	52,542.00	0.09
164	300972	万辰集团	300	52,023.00	0.09
165	603606	东方电缆	1,220	50,642.20	0.09
166	600177	雅戈尔	6,700	50,451.00	0.09
167	601000	唐山港	12,100	50,215.00	0.09
168	600026	中远海能	2,700	48,438.00	0.08
169	300390	天华新能	500	46,755.00	0.08
170	300457	赢合科技	2,200	46,376.00	0.08
171	002709	天赐材料	900	46,287.00	0.08
172	688578	艾力斯	400	43,680.00	0.07
173	600886	国投电力	3,200	42,592.00	0.07

174	000408	藏格矿业	600	41,592.00	0.07
175	300442	润泽科技	500	41,535.00	0.07
176	600118	中国卫星	500	41,025.00	0.07
177	002202	金风科技	1,700	40,630.00	0.07
178	002266	浙富控股	7,800	39,468.00	0.07
179	002410	广联达	4,800	39,168.00	0.07
180	000831	中国稀土	700	38,843.00	0.07
181	600143	金发科技	2,500	38,625.00	0.07
182	600323	瀚蓝环境	1,400	38,444.00	0.07
183	600879	航天电子	1,800	38,322.00	0.07
184	600816	建元信托	15,300	37,332.00	0.06
185	002532	天山铝业	3,400	36,482.00	0.06
186	600153	建发股份	4,600	36,478.00	0.06
187	300012	华测检测	2,600	36,036.00	0.06
188	002436	兴森科技	700	35,665.00	0.06
189	600704	物产中大	7,500	35,400.00	0.06
190	600170	上海建工	15,900	35,298.00	0.06
191	603816	顾家家居	1,500	33,540.00	0.06
192	300058	蓝色光标	2,400	33,024.00	0.06
193	002078	太阳纸业	2,600	32,474.00	0.06
194	000683	博源化工	5,600	32,256.00	0.05
195	300054	鼎龙股份	300	31,791.00	0.05
196	002837	英维克	390	31,028.40	0.05
197	688002	睿创微纳	200	30,938.00	0.05
198	002607	中公教育	16,700	30,060.00	0.05
199	600988	赤峰黄金	1,100	28,952.00	0.05
200	600111	北方稀土	600	28,830.00	0.05
201	002064	华峰化学	3,000	28,470.00	0.05
202	000519	中兵红箭	1,300	27,391.00	0.05
203	600673	东阳光	800	26,864.00	0.05
204	603885	吉祥航空	2,600	26,754.00	0.05
205	300395	菲利华	200	26,746.00	0.05
206	600754	锦江酒店	1,400	25,186.00	0.04
207	002340	格林美	3,700	24,457.00	0.04
208	000425	徐工机械	2,600	21,034.00	0.04
209	002812	恩捷股份	300	20,073.00	0.03
210	300124	汇川技术	300	19,899.00	0.03
211	300014	亿纬锂能	300	19,509.00	0.03
212	000932	华菱钢铁	5,400	18,738.00	0.03
213	600535	天士力	1,400	18,522.00	0.03
214	002273	水晶光电	500	17,740.00	0.03
215	002407	多氟多	300	15,069.00	0.03
216	603899	晨光股份	700	14,441.00	0.02

217	002544	普天科技	700	12,754.00	0.02
218	600655	豫园股份	3,000	12,330.00	0.02
219	600859	王府井	1,300	11,934.00	0.02
220	300568	星源材质	600	11,232.00	0.02
221	300003	乐普医疗	900	10,665.00	0.02
222	002714	牧原股份	300	10,497.00	0.02
223	601179	中国西电	700	10,444.00	0.02
224	600372	中航机载	900	9,765.00	0.02
225	600048	保利发展	2,100	9,723.00	0.02
226	002131	利欧股份	1,800	8,550.00	0.01
227	301358	湖南裕能	100	7,587.00	0.01
228	300207	欣旺达	300	5,697.00	0.01
229	300017	网宿科技	300	3,903.00	0.01
230	000063	中兴通讯	100	3,619.00	0.01
231	601766	中国中车	600	3,120.00	0.01

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	占基金资产净值比例 (%)
1	688416	恒烁股份	2,340	327,600.00	0.56
2	301536	星宸科技	2,200	283,162.00	0.48
3	688221	前沿生物	11,400	255,360.00	0.44
4	002378	章源钨业	7,000	234,360.00	0.40
5	601138	工业富联	3,200	230,880.00	0.39
6	000783	长江证券	22,600	220,350.00	0.38
7	688257	新锐股份	1,960	199,724.00	0.34
8	300277	汽轮科技	13,200	198,528.00	0.34
9	688197	首药控股	5,800	193,778.00	0.33
10	600061	国投资本	27,000	176,850.00	0.30
11	601939	建设银行	18,200	175,266.00	0.30
12	600022	山东钢铁	125,500	155,620.00	0.27
13	000703	恒逸石化	10,200	138,414.00	0.24
14	300498	温氏股份	11,100	136,752.00	0.23
15	000809	和展能源	42,000	133,140.00	0.23
16	002487	大金重工	2,200	127,534.00	0.22
17	603308	应流股份	1,700	102,680.00	0.17
18	600319	亚星化学	15,000	93,450.00	0.16
19	603991	领先股份	600	84,690.00	0.14
20	000681	视觉中国	4,100	81,754.00	0.14
21	002145	钛能化学	16,400	77,244.00	0.13
22	000021	深科技	1,200	77,124.00	0.13

23	300002	神州泰岳	8,500	66,385.00	0.11
24	000969	安泰科技	2,600	63,804.00	0.11
25	300459	汤姆猫	18,700	63,393.00	0.11
26	002152	广电运通	6,700	62,846.00	0.11
27	600322	津投城开	20,900	57,266.00	0.10
28	600563	法拉电子	300	57,240.00	0.10
29	002031	巨轮智能	10,000	55,800.00	0.10
30	000599	青岛双星	12,100	51,062.00	0.09
31	000801	四川九洲	3,800	49,172.00	0.08
32	002818	富森美	4,700	48,833.00	0.08
33	000708	中信特钢	3,700	46,694.00	0.08
34	002054	德美化工	6,600	43,890.00	0.07
35	603268	松发股份	300	41,784.00	0.07
36	603588	高能环境	2,100	40,320.00	0.07
37	002115	三维通信	3,900	40,170.00	0.07
38	002379	宏桥控股	2,400	35,448.00	0.06
39	002670	国盛证券	3,200	35,200.00	0.06
40	688785	恒运昌	70	32,420.50	0.06
41	600927	永安期货	2,600	32,370.00	0.06
42	300548	长芯博创	100	27,800.00	0.05
43	001277	速达股份	1,000	27,590.00	0.05
44	600037	歌华有线	3,900	24,453.00	0.04
45	688520	神州细胞	600	20,526.00	0.03
46	000009	中国宝安	2,200	13,706.00	0.02
47	002243	力合科创	1,800	11,826.00	0.02
48	300999	金龙鱼	400	9,304.00	0.02
49	600498	烽火通信	100	7,360.00	0.01
50	001914	招商积余	700	5,712.00	0.01
51	601112	振石股份	255	4,485.45	0.01
52	300253	卫宁健康	500	3,365.00	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入 金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300308	中际旭创	1,617,836.00	0.66
2	600519	贵州茅台	1,111,198.00	0.46
3	601211	国泰海通	1,088,571.00	0.45
4	601872	招商轮船	1,032,746.00	0.42
5	600050	中国联通	977,399.00	0.40
6	688012	中微公司	961,415.39	0.39

7	600030	中信证券	939,494.00	0.39
8	002028	思源电气	883,602.00	0.36
9	600549	厦门钨业	879,030.70	0.36
10	603501	豪威集团	861,764.00	0.35
11	600309	万华化学	852,340.00	0.35
12	600089	特变电工	819,093.00	0.34
13	601088	中国神华	808,002.00	0.33
14	600183	生益科技	796,795.00	0.33
15	688197	首药控股	789,166.23	0.32
16	600690	海尔智家	740,089.00	0.30
17	300442	润泽科技	722,130.00	0.30
18	600160	巨化股份	714,106.00	0.29
19	600104	上汽集团	709,944.00	0.29
20	002463	沪电股份	708,641.00	0.29

注：本项的“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	300750	宁德时代	6,259,951.00	2.57
2	600519	贵州茅台	5,767,028.00	2.37
3	601318	中国平安	4,134,896.00	1.70
4	300308	中际旭创	3,967,884.00	1.63
5	600036	招商银行	3,697,221.00	1.52
6	601899	紫金矿业	3,689,235.00	1.52
7	000333	美的集团	3,279,203.00	1.35
8	300502	新易盛	3,178,008.00	1.31
9	600900	长江电力	2,720,141.00	1.12
10	688041	海光信息	2,506,365.73	1.03
11	002475	立讯精密	2,482,069.00	1.02
12	601166	兴业银行	2,417,743.00	0.99
13	002594	比亚迪	2,371,642.00	0.97
14	688256	寒武纪	2,294,986.60	0.94
15	300274	阳光电源	2,287,900.00	0.94
16	600276	恒瑞医药	2,254,795.00	0.93
17	601398	工商银行	2,162,152.00	0.89
18	601088	中国神华	2,150,769.00	0.88
19	000858	五粮液	2,118,053.00	0.87
20	688981	中芯国际	2,108,332.84	0.87

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

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	114,453,814.40
卖出股票收入（成交）总额	260,948,704.30

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	998,852.05	1.70
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	4,000.18	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,002,852.23	1.71

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	241289	24 建控债	10,000	998,852.05	1.70
2	113704	春风转债	40	4,000.18	0.01

注：本基金本报告期末仅持有上述 2 只债券。

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

无。

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

无。

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

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响较小，符合本基金合同约定的投资政策和投资目标。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

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

7.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同约定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	—
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	45,119.30
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	45,119.30

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688072	拓荆科技	879,530.00	1.50	重大事项停牌

7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

§ 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
汇泉中证 A500 指数量化增强 A	444	75,779.70	-	-	33,646,185.73	100.00%
汇泉中证 A500 指数量化增强 C	237	74,238.20	-	-	17,594,453.59	100.00%
合计	681	75,243.23	-	-	51,240,639.32	100.00%

注：1、机构/个人投资者持有基金份额占总份额比例的计算中，针对下属分级份额，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2、户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

8.2 盈利投资者数量占比

截至本报告期末，本产品不属于成立满一年的主动管理股票型及混合型基金，故本表格所列内容不适用。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	汇泉中证 A500 指数量化增强 A	2,002.02	0.01%
	汇泉中证 A500 指数量化增强 C	18.01	0.00%
	合计	2,020.03	0.00%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。占基金总份额比例四舍五入保留至小数点后 4 位。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	汇泉中证 A500 指数量化增强 A	0~10
	汇泉中证 A500 指数量化增强 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	汇泉中证 A500 指数量化增强 A	0
	汇泉中证 A500 指数量化增强 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	汇泉中证 A500 指数量化增强 A	汇泉中证 A500 指数量化增强 C
基金合同生效日（2025 年 09 月 24 日）基金份额总额	285,203,059.96	83,840,718.28
本报告期期初基金份额总额	195,974,010.36	41,993,314.48
本报告期基金总申购份额	6,570,780.20	7,112,062.41
减：本报告期基金总赎回份额	168,898,604.83	31,510,923.30
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	33,646,185.73	17,594,453.59

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

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1. 基金管理人的重大人事变动

本报告期内基金管理人无重大人事变动。

2. 基金托管人的重大人事变动

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略无变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金所聘用的会计师事务所无变化。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人没有发生受稽查或处罚的情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人高级管理人员及相关从业人员没有发生受稽查或处罚的情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

无。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
金融街证券	4	262,982,544.39	70.07%	50,441.16	70.05%	-
中信证券	4	112,327,651.65	29.93%	21,570.41	29.95%	-

注：1、本基金使用证券公司交易结算模式，可免于执行《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》关于交易佣金分仓的规定。

2、本基金管理人负责选择证券经纪商，使用其交易单元作为本基金的交易单元。基金证券经纪商选择标准包括：公司基本面评价（财务情况、资信状况、经营情况）、公司合规风控能力评价、公司券商结算模式服务评价（稳定性、及时性）等方面，如拟使用证券经纪商的研究服务，需对公司研究服务进行评价（研究成果、研究团队）。基金证券经纪商选择程序为：根据前述标准由基金管理人考察后确定选用证券经纪商，并与其签订证券经纪服务协议。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
金融街证券	6,402,948.55	71.92%	-	-	-	-	-	-
中信证券	2,500,216.78	28.08%	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇泉中证 A500 指数量化增强型证券投资基金 2026 年第一季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2026-04-22
2	汇泉中证 A500 指数量化增强型证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2026-03-31
3	汇泉中证 A500 指数量化增强型证券投资基金 2025 年第四季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2026-01-22

§ 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

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 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、中国证监会批准汇泉中证 A500 指数量化增强证券投资基金设立的文件；
- 2、《汇泉中证 A500 指数量化增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇泉中证 A500 指数量化增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、《汇泉中证 A500 指数量化增强型证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照。

12.2 存放地点

北京市海淀区西直门外大街 168 号腾达大厦 16 层。

12.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（www.springsfund.com）查阅。

汇泉基金管理有限公司
二〇二六年八月三十一日