

汇泉中证 A500 指数量化增强型证券投资基金

2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 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 03 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。本年度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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 3 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。

本报告中财务资料已经审计。容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2025 年 9 月 24 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	8
§ 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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.9 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.....	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
§ 6 审计报告	13
6.1 审计报告基本信息.....	13
6.2 审计报告的基本内容.....	14
§ 7 年度财务报表	15
7.1 资产负债表.....	15
7.2 利润表.....	17
7.3 净资产变动表.....	18
7.4 报表附注.....	18
§ 8 投资组合报告	39
8.1 期末基金资产组合情况.....	39
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	39
8.3 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.....	40
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
8.6 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.....	49
8.7 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.....	50

8.8 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	50
8.9 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	50
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	50
8.11 投资组合报告附注	50
§ 9 基金份额持有人信息	51
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
9.3 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	51
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产 品情况	52
§ 10 开放式基金份额变动	52
§ 11 重大事件揭示	52
11.1 基金份额持有人大会决议	52
11.2 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	52
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
11.4 基金投资策略的改变	53
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	53
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
11.8 其他重大事件	54
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	54
12.1 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	54
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	54
§ 13 备查文件目录	55
13.1 备查文件目录	55
13.2 存放地点	55
13.3 查阅方式	55

§ 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	237,967,324.84 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	195,974,010.36 份	41,993,314.48 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	姓名	张强	任航

人	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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.springsfund.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2025 年 09 月 24 日（基金合同生效日）-2025 年 12 月 31 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	2,917,524.95	573,369.78
本期利润	5,845,788.90	1,385,906.49
加权平均基金份额本期利润	0.0215	0.0184
本期加权平均净值利润率	2.14%	1.84%
本期基金份额净值增长率	2.31%	2.24%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末	
期末可供分配利润	2,860,028.44	584,221.97
期末可供分配基金份额利润	0.0146	0.0139
期末基金资产净值	200,502,272.95	42,934,870.53

期末基金份额净值	1.0231	1.0224
3.1.3 累计期末指标	2025 年末	
基金份额累计净值增长率	2.31%	2.24%

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。

4、本基金合同于 2025 年 9 月 24 日生效，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

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	2.32%	0.45%	0.43%	1.00%	1.89%	-0.55%
自基金合同生效起至今	2.31%	0.43%	3.45%	1.01%	-1.14%	-0.58%

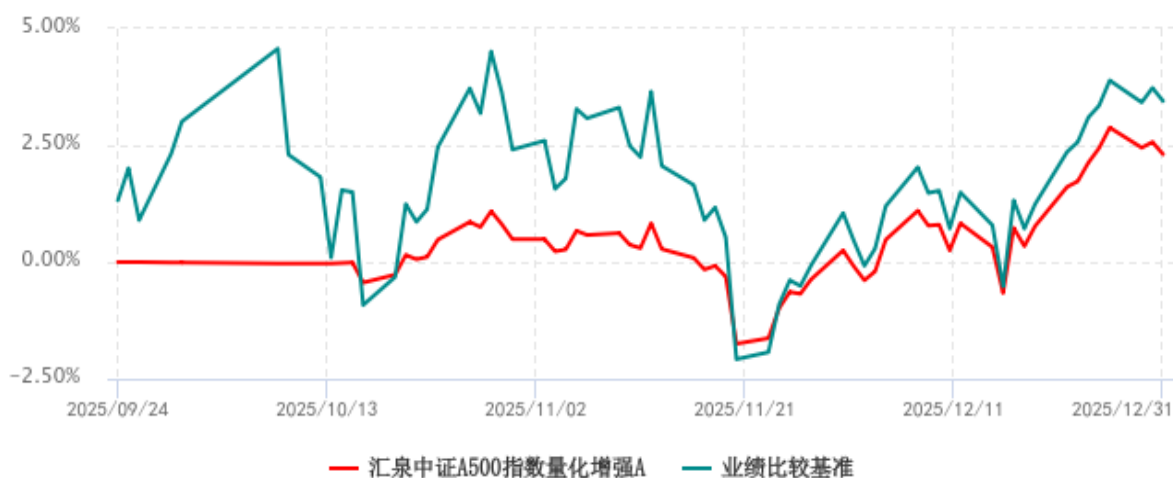
汇泉中证 A500 指数量化增强 C

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	2.25%	0.45%	0.43%	1.00%	1.82%	-0.55%
自基金合同生效起至今	2.24%	0.43%	3.45%	1.01%	-1.21%	-0.58%

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

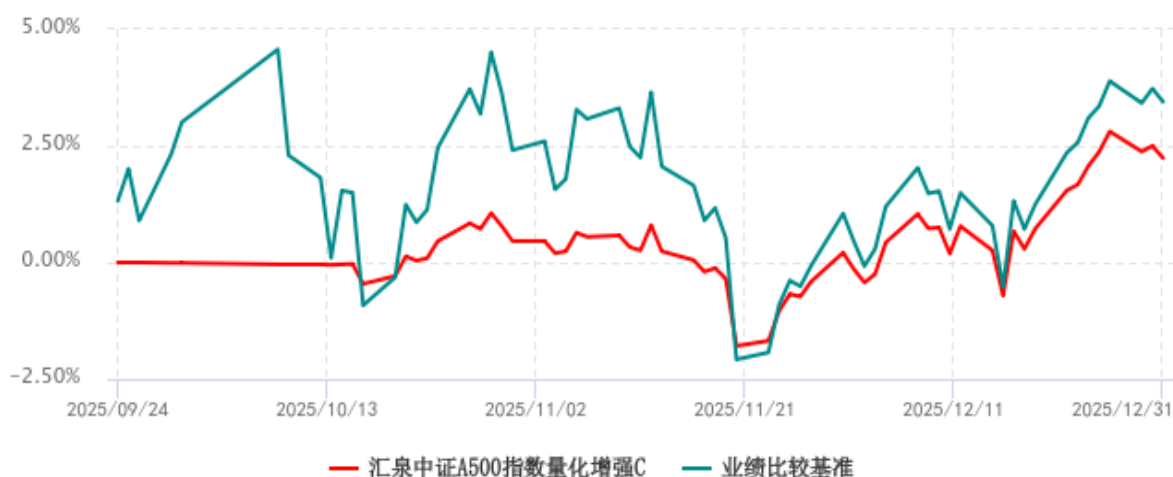
汇泉中证A500指数量化增强A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2025年09月24日-2025年12月31日)



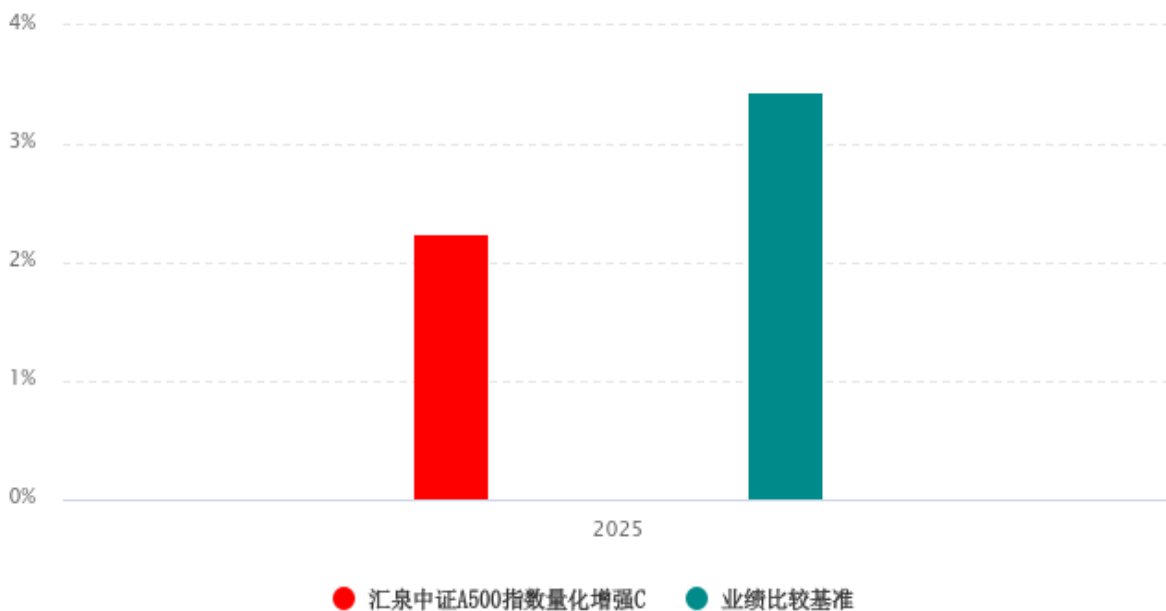
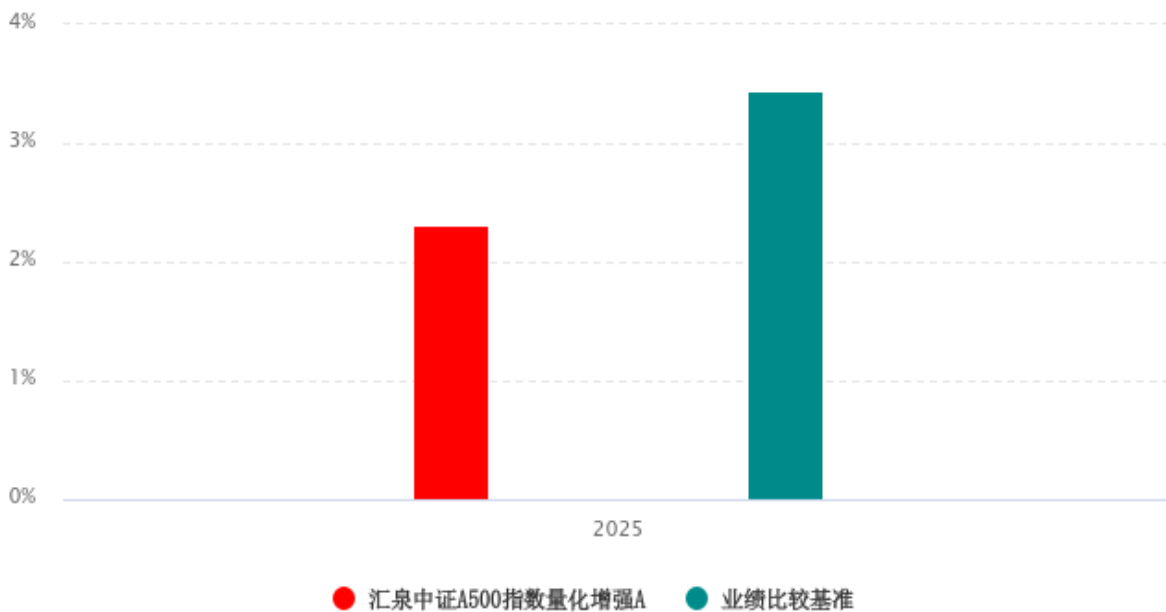
汇泉中证A500指数量化增强C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2025年09月24日-2025年12月31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，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截至本报告期末本基金仍处于建仓期。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同于 2025 年 9 月 24 日生效，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日（2025 年 09 月 24 日）至本报告期末未发生利润分配。

§ 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 13 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。

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	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基金经理兼任投资经理、首席量化投资官。

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	6	779,033,507.71	2022-09-13
	私募资产管理计划	1	52,003,432.41	2025-08-08
	其他组合	-	-	-
	合计	7	831,036,940.12	-

4.1.4 基金经理薪酬机制

对于基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况，兼任基金经理其薪酬激励与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现不直接挂钩。公司对兼任基金经理实行长期考核机制，长期投资业绩的考核结果会作为薪酬激励的参考依据，并根据监管规定落实薪酬递延机制。

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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对所有投资对象的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资和交易管理活动相关的各个业务环节，并建立了股票、债券等证券库管理办法，投资管理制度，公平交易管理办法，异常交易管理办法等与公平交易相关的公司基本制度和部门制度。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

4.3.2 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。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本报告期内，本产品基金经理同时兼任私募资产管理计划投资经理工作。公司依据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》针对同一基金经理管理的多个投资组合，加强了对投资指令、交易行为、交易监测和分析的管理，加强了事后报告机制。本报告期内，未发现本产品基金经理所管理的各个投资组合间存在不公平交易的情况。

4.3.3 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。

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 股市场整体呈现震荡上行格局，结构性行情特征显著。上证指数全年上涨 18.41%，最高突破 4000 点创近十年新高。宏观经济在政策持续发力下逐步企稳复苏，市场流动性保持合理充裕，推动风险偏好阶段性回升。在此背景下，代表 A 股核心资产的中证 A500 指数展现出良好的韧性与活力，成份股中受益于经济转型、具备科技创新和制造升级属性的细分行业龙头表现突出。

本基金严格遵循指数增强的投资纪律，以中证 A500 指数为基准，在控制跟踪误差的前提下，通过系统化的多因子量化模型进行主动管理，旨在获取持续稳健的超额收益。报告期内，我们的核心策略与运作主要围绕以下几个方面展开：精细化多因子 Alpha 模型的迭代与应用：我们持续优化适合中证 A500 指数特色的多因子模型体系。报告期内，模型在坚持估值安全边际的基础上，显著提升了对于“盈利增长动能”和“研发创新能力”因子的权重。这有效帮助我们捕捉到了在产业升级和政策扶持双重驱动下，一批业绩迎来拐点、技术壁垒较高的细分行业龙头股的投资机会。

行业与风格暴露的纪律性控制：我们严格遵守相对基准的行业中性原则，将主要的增强收益来源聚焦于行业内的个股选择。

严谨的风险管理与交易执行：我们通过风险模型对组合进行日度监控，确保跟踪误差、个股偏离度等核心风险指标始终保持在预设目标范围内。报告期内，面对市场波动，我们严格执行模型的交易信号，通过算法交易有效降低了换仓过程中的市场冲击成本。

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 1.0231 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 2.31%，同期业绩比较基准收益率为 3.45%；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 1.0224 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 2.24%，同期业绩比较基准收益率为 3.45%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年，我们认为市场及行业将继续保持连续性和稳定性，精准有力的财政政策与灵活适度的货币政策将协同配合，着力于扩大内需、提振信心、防范风险。宏观经济预计将延续“稳中提质”的态势，“新质生产力”与“高质量发展”将是明确主线。精准有力的财政政策与稳健的货币政策将共同为经济托底，企业盈利有望实现温和修复，但不同行业间的分化可能依然显著。

对于证券市场，我们认为在经济温和复苏、流动性相对充裕、政策环境友好的背景下，市场下行风险相对有限。随着经济结构的持续优化，结构性机会依然大概率是市场的主旋律。对于以中证 A500 指数为代表的细分行业龙头领域，我们尤为关注以下几点：

新质生产力的核心载体：中证 A500 指数广泛覆盖了高端制造、信息技术、新材料、生物医药等新兴产业的细分龙头。这些公司是发展“新质生产力”的主力军，将直接受益于科技创新和产业升级的政策红利。

盈利确定性与估值修复的平衡：在复杂的内外部环境，市场将更加青睐具备真实盈利能力和

稳健现金流的公司。A500 指数中包含大量传统行业中治理结构改善、盈利能力回升的优质公司，其估值吸引力突出。

流动性环境的正向驱动：充裕的市场流动性有利于中小市值公司的估值活跃度。中证 A500 指数成份股具有良好的流动性和一定的市值弹性，在风险偏好改善时往往能表现出更高的股价弹性。我们将密切关注市场流动性变化，动态调整组合的流动性暴露，以捕捉相关机会。

我们将继续秉持“纪律、系统、迭代”的投资理念，不断精进我们的量化投研体系，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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人的监察稽核工作一切从合规运作、防范和控制风险、保障基金份额持有人利益出发，由督察长领导的独立于各业务部门的监察稽核部按照规定的权限和程序，严格认真履行职责，对公司、基金运作及员工行为的合法性、合规性进行定期和不定期监督和检查。

本报告期，本基金管理人全面开展基金运作监察稽核工作，确保基金投资、营销及后台运作等各环节的合法合规。有关本基金的监察稽核主要工作如下：

- 1、研究环节，加强完善研究业务的程序合规和质量控制，规范新股等询价申购的内部流程。检查证券库的入库及维护依据，并负责关联方关系的日常维护；
- 2、投资交易环节，采用事前防范、事中控制和事后监督的工作方式，持续完善相关合规风控制度流程和系统，加强流动性指标等重要指标的监控和内幕交易防控，有效确保投研交易业务合规运作；
- 3、从业人员管理环节，加强对投资管理人员即时聊天工具、办公电话、终端设备等合规监控。监督从业人员投资信息申报工作、投资管理人员交易时段通讯工具集中管理的有效执行。采取各种有效方式防控老鼠仓、非公平交易及各种形式的利益输送行为；
- 4、基金募集与营销环节，对基金宣传推介材料及利用互联网平台营销等基金销售业务活动开展事前合规检查，做到事前防范风险，并督促落实投资者适当性管理制度，保障基金营销合法合规。此外，监督落实客户投诉处理工作，切实保障投资者利益；
- 5、基金运营环节，加强对注册登记、会计核算、基金清算、估值工作的稽核审计，保证基金运营安全、准确；
- 6、信息披露环节，严格按照法律法规及公司制度的规定，保障所披露信息的真实性、准确性和完整性。

报告期内，本基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以合规运作、防范和控制风险、保障基金份额持有人利益出发，提高内部控制和风险管理的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金自基金合同生效日（2025 年 09 月 24 日）至本报告期末未发生利润分配。

4.9 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—汇泉基金管理有限公司报告期内基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，汇泉基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，本托管人未发现有损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，汇泉基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	容诚审字[2026]200Z0164 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	汇泉中证 A500 指数量化增强型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>我们审计了汇泉中证 A500 指数量化增强型证券投资基金（以下简称“汇泉中证 A500 指数量化增强基金”）财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年 9 月 24 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了汇泉中证 A500 指数量化增强基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年 9 月 24 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则和中国注册会计师独立性准则，我们独立于汇泉中证 A500 指数量化增强基金，并遵守了独立性准则中适用于公众利益实体财务报表审计的规定，同时履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>汇泉中证 A500 指数量化增强基金的基金管理人汇泉基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估汇泉中证 A500 指数量化增强基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算汇泉中证 A500 指数量化增强基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督汇泉中证 A500 指数量化增强基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导

任	<p>致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对导致对汇泉中证 A500 指数量化增强基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致汇泉中证 A500 指数量化增强基金不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	沈兆杰 罗佳
会计师事务所的地址	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26
审计报告日期	2026-03-26

§ 7 年度财务报表

7.1 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：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日
资产：		
货币资金	7.4.7.1	24,440,193.12
结算备付金		261,600.14
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	230,211,758.51
其中：股票投资		184,734,587.00
基金投资		-
债券投资		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	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		2,004.75
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.5	-
资产总计		254,915,556.52
负债和净资产	附注号	本期末 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	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		11,099,699.42
应付管理人报酬		213,295.40
应付托管费		39,992.89
应付销售服务费		13,121.81
应付投资顾问费		-
应交税费		38,028.52
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.6	74,275.00
负债合计		11,478,413.04
净资产：		
实收基金	7.4.7.7	237,967,324.84
未分配利润	7.4.7.8	5,469,818.64

净资产合计		243,437,143.48
负债和净资产总计		254,915,556.52

注：1、报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额总额 237,967,324.84 份。其中汇泉中证 A500 指数量化增强 A 基金份额净值 1.0231 元，基金份额总额 195,974,010.36 份；汇泉中证 A500 指数量化增强 C 基金份额净值 1.0224 元，基金份额总额 41,993,314.48 份。

2、本基金于 2025 年 09 月 24 日成立，本财务报表的实际编制期间为 2025 年 09 月 24 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日止。

7.2 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：2025 年 09 月 24 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 09 月 24 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
一、营业总收入		8,255,325.94
1. 利息收入		257,461.71
其中：存款利息收入	7.4.7.9	255,135.47
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		2,326.24
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,257,058.73
其中：股票投资收益	7.4.7.10	2,837,777.86
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.11	-72,444.03
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-
衍生工具收益	7.4.7.14	1,046,554.97
股利收益	7.4.7.15	445,169.93
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	3,740,800.66
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	4.84
减：二、营业总支出		1,023,630.55
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	752,367.56
2. 托管费	7.4.10.2.2	141,068.96
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	51,103.15
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		4,190.88
8. 其他费用	7.4.7.18	74,900.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,231,695.39
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,231,695.39
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		7,231,695.39

7.3 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：2025 年 09 月 24 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2025 年 09 月 24 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	369,043,778.24	-	369,043,778.24
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-131,076,453.40	5,469,818.64	-125,606,634.76
（一）、综合收益总额	-	7,231,695.39	7,231,695.39
（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）	-131,076,453.40	-1,761,876.75	-132,838,330.15
其中：1. 基金申购款	631,253.84	4,924.57	636,178.41
2. 基金赎回款	-131,707,707.24	-1,766,801.32	-133,474,508.56
（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	237,967,324.84	5,469,818.64	243,437,143.48

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

陈洪斌	陈磊	劳成名
-----	-----	-----
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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融券业务。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×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《汇泉中证 A500 指数量化增强型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2025 年 9 月 24 日(基金合同生效日)至 2025 年 12 月 31 日止期间的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 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年 9 月 24 日(基金合同生效日)至 2025 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2025 年 9 月 24 日(基金合同生效日)至 2025 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具, 是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时, 确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为: 以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具, 分别采用以下两种方式进行计量:

以摊余成本计量:

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标, 且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致, 即在特定日期产生的现金流量, 仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益:

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具, 以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资, 在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益, 在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有

充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成

果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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]36号《财政部、国家税务总

局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《财政部、国家税务总局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《财政部、国家税务总局关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部、国家税务总局、证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《财政部、国家税务总局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《财政部、国家税务总局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《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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日
活期存款	802,176.92
等于：本金	801,624.28
加：应计利息	552.64
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	23,638,016.20
等于：本金	23,637,428.54
加：应计利息	587.66
减：坏账准备	-
合计	24,440,193.12

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。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	180,969,536.41	-	184,734,587.00	3,765,050.59	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	3,991,376.66	39,029.04	4,017,229.04	-13,176.66
	银行间市场	40,865,673.27	605,342.47	41,459,942.47	-11,073.27
	合计	44,857,049.93	644,371.51	45,477,171.51	-24,249.93
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	225,826,586.34	644,371.51	230,211,758.51	3,740,800.66	

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 其他资产

无。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 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	1,175.00
其中：交易所市场	-
银行间市场	1,175.00
应付利息	-
预提费用	73,100.00
合计	74,275.00

7.4.7.7 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 2025 年 09 月 24 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	285,203,059.96	285,203,059.96
本期申购	361,570.00	361,570.00
本期赎回（以“-”号填列）	-89,590,619.60	-89,590,619.60
本期末	195,974,010.36	195,974,010.36

汇泉中证 A500 指数量化增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 09 月 24 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	83,840,718.28	83,840,718.28
本期申购	269,683.84	269,683.84
本期赎回（以“-”号填列）	-42,117,087.64	-42,117,087.64
本期末	41,993,314.48	41,993,314.48

注：1、申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2、本基金自 2025 年 9 月 5 日至 2025 年 9 月 18 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 368,906,553.70 元，折合为 368,906,553.70 份基金份额（其中 A 类基金份额 285,098,932.72 份，C 类基金份额 83,807,620.98 份）。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》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 137,224.54 元，在本基金成立后，折合为 137,224.54 份基金份额(其中 A 类基金份额 104,127.24 份,C 类基金份额 33,097.30 份)，划入基金份额持有人账户。

3、根据《汇泉中证 A500 指数量化增强型证券投资基金基金合同》、《汇泉中证 A500 指数量化增强型证券投资基金招募说明书》及《汇泉中证 A500 指数量化增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告》的相关规定，本基金于 2025 年 9 月 24 日(基金合同生效日)至 2025 年 11 月 19 日止期间暂不向投资人开放基金交易，申购、赎回、转换及定期定额投资业务自 2025 年 11 月 20 日起开始办理。

7.4.7.8 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	2,917,524.95	2,928,263.95	5,845,788.90
本期基金份额交易产生的变动数	-57,496.51	-1,260,029.80	-1,317,526.31
其中：基金申购款	-83.27	4,362.00	4,278.73
基金赎回款	-57,413.24	-1,264,391.80	-1,321,805.04
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,860,028.44	1,668,234.15	4,528,262.59

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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	573,369.78	812,536.71	1,385,906.49
本期基金份额交易产生的变动数	10,852.19	-455,202.63	-444,350.44
其中：基金申购款	-146.55	792.39	645.84
基金赎回款	10,998.74	-455,995.02	-444,996.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	584,221.97	357,334.08	941,556.05

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 09 月 24 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	62,970.88
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	8,573.40
结算备付金利息收入	183,591.19
其他	-
合计	255,135.47

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。

7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 09 月 24 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	161,974,493.04
减：卖出股票成本总额	158,927,302.85
减：交易费用	209,412.33
买卖股票差价收入	2,837,777.86

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 09 月 24 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	115,654.33
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-188,098.36
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	-72,444.03

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 09 月 24 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	34,329,749.05
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	34,355,627.64
减：应计利息总额	160,311.24
减：交易费用	1,908.53
买卖债券差价收入	-188,098.36

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.13 贵金属投资收益

无。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 09 月 24 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	1,046,554.97

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 09 月 24 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	445,169.93
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	445,169.93

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 09 月 24 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	3,740,800.66
——股票投资	3,765,050.59
——债券投资	-24,249.93
——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	3,740,800.66

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 09 月 24 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	4.84
合计	4.84

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。

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 09 月 24 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
审计费用	40,000.00
信息披露费	30,000.00
证券出借违约金	-
银行汇划费	600.00
其他	1,200.00
账户维护费	3,100.00
合计	74,900.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

无。

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

无。

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 09 月 24 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	752,367.56
其中：应支付销售机构的客户维护费	375,863.33
应支付基金管理人的净管理费	376,504.23

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 09 月 24 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	141,068.96

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。

7.4.10.2.3 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 2025 年 09 月 24 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 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
汇泉基金管理有限公司	-	0.47	0.47
农业银行	-	33,413.57	33,413.57
合计	-	33,414.04	33,414.04

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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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 2025 年 09 月 24 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
农业银行	802,176.92	62,970.88

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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2025 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 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
002049	紫光国微	2025-12-30	重大事项	78.81	2026-01-15	86.69	2,700	206,378.00	212,787.00	-
688012	中微公司	2025-12-19	拟筹划重大资产重组	272.72	2026-01-05	278.00	200	54,706.19	54,544.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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险，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。

7.4.13.2 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同责任，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，其他存款存放于恒泰证券股份有限公司（2025 年 9 月 9 日更名为金融街证券股份有限公司）、中信证券股份有限公司，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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 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 2025 年 12 月 31 日
AAA	17,277,525.48
AAA 以下	28,199,646.03
未评级	-
合计	45,477,171.51

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 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 2025 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股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 7.4.12。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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2025 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为 18.68%，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	184,734,587.00	75.89
交易性金融资产—基金投资	-	-
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	184,734,587.00	75.89

7.4.13.4.3.2 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 2025 年 12 月 31 日
	1. 中证 A500 指数收益率上升 5%	3,895,177.84
	2. 中证 A500 指数收益率下降 5%	-3,895,177.84

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日
第一层次	184,467,256.00
第二层次	45,744,502.51
第三层次	-
合计	230,211,758.51

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

无。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2025 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	184,734,587.00	72.47
	其中：股票	184,734,587.00	72.47
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	45,477,171.51	17.84
	其中：债券	45,477,171.51	17.84
	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	24,701,793.26	9.69
8	其他各项资产	2,004.75	0.00
9	合计	254,915,556.52	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	305,118.00	0.13
B	采矿业	11,803,621.00	4.85
C	制造业	97,553,115.00	40.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,917,933.00	1.61
E	建筑业	2,785,117.00	1.14
F	批发和零售业	612,604.00	0.25
G	交通运输、仓储和邮政业	3,667,555.00	1.51

H	住宿和餐饮业	152,425.00	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,375,529.00	4.67
J	金融业	23,139,501.00	9.51
K	房地产业	632,233.00	0.26
L	租赁和商务服务业	1,912,945.00	0.79
M	科学研究和技术服务业	2,405,052.00	0.99
N	水利、环境和公共设施管理业	276,642.00	0.11
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	36,036.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	160,575,426.00	65.96

8.2.2 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	734,280.00	0.30
B	采矿业	891,520.00	0.37
C	制造业	14,309,400.00	5.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	610,760.00	0.25
E	建筑业	289,080.00	0.12
F	批发和零售业	303,901.00	0.12
G	交通运输、仓储和邮政业	1,812,056.00	0.74
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	580,919.00	0.24
J	金融业	3,070,494.00	1.26
K	房地产业	933,543.00	0.38
L	租赁和商务服务业	18,198.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	605,010.00	0.25
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	24,159,161.00	9.92

8.3 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

8.3.1 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	19,500	7,161,570.00	2.94
2	600519	贵州茅台	4,400	6,059,592.00	2.49
3	601318	中国平安	71,600	4,897,440.00	2.01
4	600036	招商银行	105,100	4,424,710.00	1.82
5	601899	紫金矿业	124,400	4,288,068.00	1.76
6	000333	美的集团	43,500	3,399,525.00	1.40
7	300502	新易盛	7,400	3,188,512.00	1.31
8	300308	中际旭创	5,200	3,172,000.00	1.30
9	601166	兴业银行	148,600	3,129,516.00	1.29
10	600900	长江电力	111,500	3,031,685.00	1.25
11	688256	寒武纪	2,200	2,982,210.00	1.23
12	601398	工商银行	343,500	2,723,955.00	1.12
13	600276	恒瑞医药	43,200	2,573,424.00	1.06
14	002475	立讯精密	44,300	2,512,253.00	1.03
15	002594	比亚迪	25,100	2,452,772.00	1.01
16	300274	阳光电源	14,100	2,411,664.00	0.99
17	688981	中芯国际	18,500	2,272,355.00	0.93
18	603259	药明康德	24,800	2,247,872.00	0.92
19	000858	五粮液	20,900	2,214,146.00	0.91
20	688041	海光信息	9,600	2,154,336.00	0.88
21	601328	交通银行	293,500	2,127,875.00	0.87
22	300476	胜宏科技	7,100	2,041,818.00	0.84
23	002371	北方华创	4,400	2,019,952.00	0.83
24	000725	京东方 A	421,200	1,773,252.00	0.73
25	600150	中国船舶	52,600	1,749,476.00	0.72
26	300124	汇川技术	22,400	1,687,392.00	0.69
27	601088	中国神华	41,400	1,676,700.00	0.69
28	601668	中国建筑	320,000	1,641,600.00	0.67
29	600887	伊利股份	56,900	1,627,340.00	0.67
30	601816	京沪高铁	310,900	1,601,135.00	0.66
31	600031	三一重工	73,500	1,553,055.00	0.64
32	300760	迈瑞医疗	7,900	1,504,555.00	0.62
33	601012	隆基绿能	78,900	1,435,980.00	0.59
34	601728	中国电信	227,400	1,432,620.00	0.59
35	603799	华友钴业	20,600	1,406,156.00	0.58
36	601988	中国银行	236,000	1,352,280.00	0.56
37	002230	科大讯飞	26,500	1,332,685.00	0.55
38	600028	中国石化	213,100	1,316,958.00	0.54
39	601857	中国石油	123,600	1,286,676.00	0.53
40	300059	东方财富	55,400	1,284,172.00	0.53
41	000792	盐湖股份	44,500	1,253,120.00	0.51
42	688111	金山办公	4,000	1,228,280.00	0.50
43	000651	格力电器	30,200	1,214,644.00	0.50

44	601127	赛力斯	9,900	1,197,504.00	0.49
45	002463	沪电股份	16,200	1,183,734.00	0.49
46	600885	宏发股份	37,700	1,146,080.00	0.47
47	600030	中信证券	38,600	1,108,206.00	0.46
48	000538	云南白药	18,900	1,072,764.00	0.44
49	600893	航发动力	26,500	1,060,795.00	0.44
50	603019	中科曙光	12,200	1,044,808.00	0.43
51	603993	洛阳钼业	51,700	1,034,000.00	0.42
52	600309	万华化学	12,600	966,168.00	0.40
53	600011	华能国际	118,800	886,248.00	0.36
54	002415	海康威视	29,500	880,280.00	0.36
55	002384	东山精密	10,200	863,430.00	0.35
56	600026	中远海能	73,700	860,816.00	0.35
57	600166	福田汽车	283,000	826,360.00	0.34
58	600010	包钢股份	339,700	808,486.00	0.33
59	300033	同花顺	2,500	805,450.00	0.33
60	002050	三花智控	14,000	774,340.00	0.32
61	601601	中国太保	18,400	771,144.00	0.32
62	600115	中国东航	122,200	733,200.00	0.30
63	600089	特变电工	31,500	699,930.00	0.29
64	002625	光启技术	13,100	638,756.00	0.26
65	600879	航天电子	29,200	622,544.00	0.26
66	600418	江淮汽车	12,100	598,950.00	0.25
67	601669	中国电建	114,200	593,840.00	0.24
68	000988	华工科技	7,400	587,042.00	0.24
69	300450	先导智能	11,300	564,774.00	0.23
70	002558	巨人网络	12,700	549,783.00	0.23
71	688072	拓荆科技	1,600	528,000.00	0.22
72	300014	亿纬锂能	8,000	526,080.00	0.22
73	002027	分众传媒	71,300	525,481.00	0.22
74	600941	中国移动	5,200	525,460.00	0.22
75	601100	恒立液压	4,700	516,577.00	0.21
76	002131	利欧股份	85,900	484,476.00	0.20
77	601168	西部矿业	17,100	472,644.00	0.19
78	688235	百济神州	1,700	456,620.00	0.19
79	600895	张江高科	10,300	452,170.00	0.19
80	002407	多氟多	13,200	447,612.00	0.18
81	600118	中国卫星	4,700	446,265.00	0.18
82	002555	三七互娱	18,700	441,320.00	0.18
83	002202	金风科技	21,500	438,600.00	0.18
84	000831	中国稀土	9,400	436,536.00	0.18
85	300604	长川科技	4,200	425,502.00	0.17
86	002812	恩捷股份	7,500	424,800.00	0.17

87	603288	海天味业	11,300	418,326.00	0.17
88	300418	昆仑万维	10,000	417,000.00	0.17
89	002465	海格通信	26,400	415,800.00	0.17
90	300454	深信服	3,600	414,576.00	0.17
91	600547	山东黄金	10,700	414,197.00	0.17
92	002601	龙佰集团	21,100	413,138.00	0.17
93	002185	华天科技	35,700	391,629.00	0.16
94	300751	迈为股份	1,900	391,381.00	0.16
95	603659	璞泰来	14,200	388,228.00	0.16
96	002195	岩山科技	53,900	382,151.00	0.16
97	300496	中科创达	5,600	378,000.00	0.16
98	000960	锡业股份	13,400	373,592.00	0.15
99	600141	兴发集团	10,800	373,464.00	0.15
100	600585	海螺水泥	17,000	371,620.00	0.15
101	002156	通富微电	9,800	369,460.00	0.15
102	300866	安克创新	3,200	366,048.00	0.15
103	000034	神州数码	9,400	365,754.00	0.15
104	300346	南大光电	8,500	364,650.00	0.15
105	300073	当升科技	6,300	364,140.00	0.15
106	300002	神州泰岳	31,500	362,880.00	0.15
107	603087	甘李药业	5,300	360,771.00	0.15
108	002128	电投能源	12,900	360,039.00	0.15
109	002223	鱼跃医疗	9,400	359,174.00	0.15
110	300474	景嘉微	4,900	352,163.00	0.14
111	000423	东阿阿胶	7,100	348,468.00	0.14
112	600000	浦发银行	27,800	345,832.00	0.14
113	300919	中伟新材	7,400	342,842.00	0.14
114	603979	金诚信	4,500	342,675.00	0.14
115	002409	雅克科技	4,600	340,860.00	0.14
116	300003	乐普医疗	21,500	339,915.00	0.14
117	002624	完美世界	20,600	337,634.00	0.14
118	000415	渤海租赁	82,800	335,340.00	0.14
119	000683	博源化工	44,600	331,824.00	0.14
120	002821	凯莱英	3,500	325,255.00	0.13
121	000400	许继电气	12,500	321,375.00	0.13
122	605589	圣泉集团	11,300	319,790.00	0.13
123	300438	鹏辉能源	6,000	319,320.00	0.13
124	600988	赤峰黄金	10,200	318,648.00	0.13
125	600415	小商品城	19,600	312,620.00	0.13
126	300037	新宙邦	5,800	303,920.00	0.12
127	002414	高德红外	20,000	293,400.00	0.12
128	688617	惠泰医疗	1,200	291,924.00	0.12
129	002312	川发龙蟒	26,400	288,552.00	0.12

130	601058	赛轮轮胎	17,600	284,768.00	0.12
131	600989	宝丰能源	14,400	282,672.00	0.12
132	600667	太极实业	35,300	281,341.00	0.12
133	000066	中国长城	19,300	278,113.00	0.11
134	603568	伟明环保	10,900	276,642.00	0.11
135	688271	联影医疗	2,200	276,100.00	0.11
136	601390	中国中铁	49,600	268,336.00	0.11
137	000878	云南铜业	12,900	264,579.00	0.11
138	002405	四维图新	29,300	263,993.00	0.11
139	688578	艾力斯	2,500	260,375.00	0.11
140	300757	罗博特科	1,100	256,630.00	0.11
141	601727	上海电气	29,800	256,578.00	0.11
142	600176	中国巨石	14,800	253,080.00	0.10
143	600839	四川长虹	26,500	241,150.00	0.10
144	002714	牧原股份	4,700	237,726.00	0.10
145	002318	久立特材	8,000	231,600.00	0.10
146	600398	海澜之家	36,800	222,640.00	0.09
147	002049	紫光国微	2,700	212,787.00	0.09
148	000063	中兴通讯	5,500	208,120.00	0.09
149	600660	福耀玻璃	3,200	207,264.00	0.09
150	002841	视源股份	5,200	206,076.00	0.08
151	600741	华域汽车	10,200	204,000.00	0.08
152	002271	东方雨虹	14,900	202,491.00	0.08
153	688008	澜起科技	1,700	200,260.00	0.08
154	000338	潍柴动力	11,600	199,520.00	0.08
155	603129	春风动力	700	195,076.00	0.08
156	603986	兆易创新	900	192,825.00	0.08
157	601866	中远海发	76,300	192,276.00	0.08
158	601233	桐昆股份	10,700	184,147.00	0.08
159	600153	建发股份	19,600	181,300.00	0.07
160	600704	物产中大	31,700	176,569.00	0.07
161	002078	太阳纸业	11,000	173,250.00	0.07
162	601216	君正集团	35,000	168,700.00	0.07
163	603885	吉祥航空	11,100	165,168.00	0.07
164	603816	顾家家居	5,300	162,922.00	0.07
165	000932	华菱钢铁	28,000	157,360.00	0.06
166	300012	华测检测	11,600	157,180.00	0.06
167	600256	广汇能源	31,500	154,980.00	0.06
168	600258	首旅酒店	9,100	152,425.00	0.06
169	600637	东方明珠	14,200	139,870.00	0.06
170	002460	赣锋锂业	2,200	138,358.00	0.06
171	000425	徐工机械	11,800	136,644.00	0.06
172	002064	华峰化学	11,500	126,500.00	0.05

173	002738	中矿资源	1,600	125,680.00	0.05
174	000009	中国宝安	12,400	122,140.00	0.05
175	000039	中集集团	12,100	122,089.00	0.05
176	002352	顺丰控股	3,000	114,960.00	0.05
177	000547	航天发展	3,400	112,234.00	0.05
178	000519	中兵红箭	6,000	109,260.00	0.04
179	600499	科达制造	7,500	104,025.00	0.04
180	600549	厦门钨业	2,500	102,650.00	0.04
181	600096	云天化	2,700	90,207.00	0.04
182	000426	兴业银锡	2,500	89,000.00	0.04
183	600048	保利发展	14,100	86,010.00	0.04
184	300207	欣旺达	3,200	83,680.00	0.03
185	300001	特锐德	3,200	82,176.00	0.03
186	300339	润和软件	1,600	79,200.00	0.03
187	300058	蓝色光标	6,400	73,728.00	0.03
188	601966	玲珑轮胎	5,000	72,650.00	0.03
189	600655	豫园股份	13,700	70,281.00	0.03
190	603899	晨光股份	2,500	67,650.00	0.03
191	000998	隆平高科	7,200	67,392.00	0.03
192	600143	金发科技	3,300	64,482.00	0.03
193	002340	格林美	7,700	64,372.00	0.03
194	600208	衢州发展	16,300	63,081.00	0.03
195	600487	亨通光电	2,500	61,825.00	0.03
196	000933	神火股份	2,200	60,434.00	0.02
197	002517	恺英网络	2,700	59,049.00	0.02
198	600111	北方稀土	1,200	55,344.00	0.02
199	002456	欧菲光	5,200	55,224.00	0.02
200	688012	中微公司	200	54,544.00	0.02
201	600436	片仔癀	300	50,634.00	0.02
202	601225	陕西煤业	2,300	49,036.00	0.02
203	000001	平安银行	4,100	46,781.00	0.02
204	002436	兴森科技	2,100	44,457.00	0.02
205	002532	天山铝业	2,700	43,686.00	0.02
206	600745	闻泰科技	1,100	41,008.00	0.02
207	300017	网宿科技	3,800	38,950.00	0.02
208	300251	光线传媒	2,200	36,036.00	0.01
209	002353	杰瑞股份	500	35,415.00	0.01
210	600535	天士力	2,200	33,154.00	0.01
211	301358	湖南裕能	500	32,330.00	0.01
212	001914	招商积余	2,900	30,972.00	0.01
213	688120	华海清科	200	30,016.00	0.01
214	002294	信立泰	600	29,730.00	0.01
215	002273	水晶光电	1,100	27,632.00	0.01

216	300395	菲利华	200	20,060.00	0.01
217	688777	中控技术	200	9,868.00	0.00
218	300142	沃森生物	800	8,728.00	0.00
219	002008	大族激光	200	8,238.00	0.00
220	300136	信维通信	100	6,200.00	0.00
221	300390	天华新能	100	5,461.00	0.00

8.3.2 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	600639	浦东金桥	90,900	933,543.00	0.38
2	600873	梅花生物	90,600	917,778.00	0.38
3	301606	绿联科技	15,600	916,344.00	0.38
4	300357	我武生物	31,900	904,365.00	0.37
5	001337	四川黄金	32,000	891,520.00	0.37
6	300695	兆丰股份	8,200	820,492.00	0.34
7	001317	三羊马	13,500	743,985.00	0.31
8	300498	温氏股份	43,500	734,280.00	0.30
9	600221	海航控股	403,700	730,697.00	0.30
10	603061	金海通	5,200	730,080.00	0.30
11	000612	焦作万方	66,100	728,422.00	0.30
12	300711	广哈通信	31,300	726,786.00	0.30
13	601169	北京银行	132,400	725,552.00	0.30
14	600109	国金证券	77,600	721,680.00	0.30
15	603190	亚通精工	26,700	720,099.00	0.30
16	600095	湘财股份	64,400	712,264.00	0.29
17	601138	工业富联	11,300	701,165.00	0.29
18	000657	中钨高新	24,600	681,666.00	0.28
19	603099	长白山	13,400	605,010.00	0.25
20	000561	烽火电子	37,100	453,362.00	0.19
21	002056	横店东磁	22,800	444,600.00	0.18
22	000767	晋控电力	146,000	408,800.00	0.17
23	300255	常山药业	6,000	372,600.00	0.15
24	600919	江苏银行	34,800	361,920.00	0.15
25	001267	汇绿生态	13,200	289,080.00	0.12
26	603267	鸿远电子	3,900	212,277.00	0.09
27	600602	云赛智联	11,300	211,197.00	0.09
28	301195	北路智控	6,100	210,633.00	0.09
29	002979	雷赛智能	5,000	210,350.00	0.09
30	000810	创维数字	17,600	207,328.00	0.09
31	002296	辉煌科技	18,400	206,080.00	0.08

32	002406	远东传动	25,900	205,646.00	0.08
33	001389	广合科技	2,500	204,075.00	0.08
34	300224	正海磁材	13,200	204,072.00	0.08
35	002531	天顺风能	29,700	203,742.00	0.08
36	000795	英洛华	20,400	203,388.00	0.08
37	300441	鲍斯股份	26,900	203,095.00	0.08
38	601139	深圳燃气	30,600	201,960.00	0.08
39	601061	中信金属	14,000	201,600.00	0.08
40	605066	天正电气	27,500	200,750.00	0.08
41	603107	上海汽配	13,500	200,205.00	0.08
42	605305	中际联合	4,800	199,968.00	0.08
43	002884	凌霄泵业	11,300	199,897.00	0.08
44	603281	江瀚新材	7,200	199,800.00	0.08
45	601083	锦江航运	17,900	199,764.00	0.08
46	600267	海正药业	20,100	198,789.00	0.08
47	300296	利亚德	31,400	198,448.00	0.08
48	300595	欧普康视	13,500	198,315.00	0.08
49	600369	西南证券	40,300	180,544.00	0.07
50	301031	中熔电气	1,600	179,504.00	0.07
51	605319	无锡振华	8,500	178,840.00	0.07
52	002247	聚力文化	61,200	171,972.00	0.07
53	601995	中金公司	4,900	171,500.00	0.07
54	300157	新锦动力	35,800	162,532.00	0.07
55	601298	青岛港	16,500	137,610.00	0.06
56	300334	津膜科技	19,300	134,328.00	0.06
57	300702	天宇股份	5,600	132,160.00	0.05
58	601198	东兴证券	7,700	106,876.00	0.04
59	300319	麦捷科技	7,900	92,351.00	0.04
60	301032	新柴股份	6,800	81,804.00	0.03
61	603000	人民网	4,200	80,010.00	0.03
62	300050	世纪鼎利	14,300	79,079.00	0.03
63	002831	裕同科技	2,700	76,977.00	0.03
64	000501	武商集团	7,600	76,912.00	0.03
65	601059	信达证券	4,200	74,382.00	0.03
66	301055	张小泉	3,400	66,674.00	0.03
67	002508	老板电器	3,400	65,790.00	0.03
68	601636	旗滨集团	11,000	65,230.00	0.03
69	002276	万马股份	3,400	57,494.00	0.02
70	605358	立昂微	1,400	48,748.00	0.02
71	600335	国机汽车	3,900	25,389.00	0.01
72	600295	鄂尔多斯	1,700	21,012.00	0.01
73	002127	南极电商	5,400	18,198.00	0.01
74	601939	建设银行	1,700	15,776.00	0.01

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	8,263,613.00	3.39
2	600519	贵州茅台	7,912,845.00	3.25
3	600036	招商银行	4,651,888.75	1.91
4	601318	中国平安	4,462,459.00	1.83
5	601899	紫金矿业	4,392,685.89	1.80
6	688981	中芯国际	4,119,540.46	1.69
7	002594	比亚迪	3,980,882.00	1.64
8	000333	美的集团	3,923,149.72	1.61
9	300059	东方财富	3,831,492.00	1.57
10	601166	兴业银行	3,824,017.00	1.57
11	600030	中信证券	3,452,351.35	1.42
12	300502	新易盛	3,359,779.80	1.38
13	600900	长江电力	3,305,280.00	1.36
14	300308	中际旭创	3,295,142.00	1.35
15	600276	恒瑞医药	3,071,901.00	1.26
16	000858	五粮液	3,019,239.00	1.24
17	688256	寒武纪	2,962,232.00	1.22
18	601398	工商银行	2,836,662.00	1.17
19	600887	伊利股份	2,789,579.00	1.15
20	300124	汇川技术	2,768,905.00	1.14

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601211	国泰海通	2,722,381.00	1.12
2	300059	东方财富	2,333,504.00	0.96
3	600030	中信证券	2,321,110.00	0.95
4	688981	中芯国际	1,769,219.36	0.73
5	603986	兆易创新	1,631,808.00	0.67
6	603501	豪威集团	1,623,636.00	0.67
7	600406	国电南瑞	1,623,076.00	0.67
8	600183	生益科技	1,608,570.40	0.66
9	688008	澜起科技	1,595,087.00	0.66
10	300394	天孚通信	1,574,064.40	0.65
11	600111	北方稀土	1,499,723.00	0.62

12	688111	金山办公	1,482,899.04	0.61
13	002028	思源电气	1,463,504.40	0.60
14	600104	上汽集团	1,455,747.00	0.60
15	600690	海尔智家	1,433,437.00	0.59
16	002594	比亚迪	1,414,702.00	0.58
17	600941	中国移动	1,404,237.00	0.58
18	600519	贵州茅台	1,402,791.00	0.58
19	601766	中国中车	1,367,235.00	0.56
20	601919	中远海控	1,333,384.00	0.55

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。

8.4.3 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	339,896,839.26
卖出股票收入（成交）总额	161,974,493.04

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。

8.5 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	20,021,969.87	8.22
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	12,194,905.20	5.01
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	13,260,296.44	5.45
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	45,477,171.51	18.68

8.6 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	232580059	25 江苏长江商行二级资本债 01	100,000	10,033,624.66	4.12
2	242580064	25 同方全球人寿永续债 01	100,000	9,988,345.21	4.10

3	102581404	25 陕西建工 MTN001	80,000	8,181,098.08	3.36
4	1880045	18 兰轨道债 02	70,000	8,177,676.16	3.36
5	102400874	24 首开 MTN005B	50,000	5,079,198.36	2.09

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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

除江苏银行股份有限公司、上海银行股份有限公司、中国平安保险(集团)股份有限公司、招商银行股份有限公司外，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。

本基金投资江苏银行股份有限公司、上海银行股份有限公司、中国平安保险(集团)股份有限公司、招商银行股份有限公司的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

8.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规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规定的备选股票库。

8.11.3 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	2,004.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,004.75

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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	1,154	169,821.50	495,282.83	0.25%	195,478,727.53	99.75%
汇泉中证 A500 指数量化增强 C	358	117,299.76	-	-	41,993,314.48	100%
合计	1,512	157,385.80	495,282.83	0.21%	237,472,042.01	99.79%

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。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有 从业人员持有本 基金	汇泉中证 A500 指数量化增强 A	15.97	0.00%
	汇泉中证 A500 指数量化增强 C	18.01	0.00%
	合计	33.98	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）。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

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

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产
品情况

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产 品份额总量的数量区间（万 份）
杨宇	公募基金	>100
	私募资产管理计划	10~50
	合计	>100

§ 10 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
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购 份额	361,570.00	269,683.84
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总 赎回份额	89,590,619.60	42,117,087.64
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变 动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	195,974,010.36	41,993,314.48

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

2025 年 2 月，中国农业银行总行决定陈振华任托管业务部副总裁。

2025 年 3 月，中国农业银行总行决定常佳任托管业务部副总裁。

2025 年 4 月，中国农业银行总行决定李亚红任托管业务部高级专家。

2025 年 9 月，中国农业银行总行决定蔡崎峰任托管业务部总裁。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略无变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金提供审计服务的机构为容诚会计师事务所(特殊普通合伙)。本报告年度的审计费用为 40,000.00 元人民币。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员没有发生受稽查或处罚的情况。

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员没有发生受稽查或处罚的情况。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的相关从业人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
恒泰证券	4	339,294,503.69	67.61%	66,407.24	67.90%	-
中信证券	4	162,576,828.61	32.39%	31,390.08	32.10%	-

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。

3、交易单元变更情况

本报告期内，本基金新增中信证券交易单元 4 个及恒泰证券交易单元 4 个。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
恒泰证券	25,269,147.39	77.34%	81,500,000.00	100.00%	-	-	-	-
中信证券	7,402,163.48	22.66%	-	-	-	-	-	-

11.8 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招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2025-09-01
2	汇泉中证 A500 指数量化增强型证券投资基金托管协议	中国证监会指定报刊及网站	2025-09-01
3	汇泉中证 A500 指数量化增强型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2025-09-01
4	汇泉中证 A500 指数量化增强型证券投资基金基金合同	中国证监会指定报刊及网站	2025-09-01
5	汇泉中证 A500 指数量化增强型证券投资基金基金份额发售公告	中国证监会指定报刊及网站	2025-09-01
6	汇泉中证 A500 指数量化增强型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要	中国证监会指定报刊及网站	2025-09-01
7	汇泉中证 A500 指数量化增强型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要	中国证监会指定报刊及网站	2025-09-01
8	汇泉中证 A500 指数量化增强型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会指定报刊及网站	2025-09-25
9	汇泉中证 A500 指数量化增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025-11-19

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 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。

13.2 存放地点

北京市海淀区西直门外大街 168 号腾达大厦 16 层。

13.3 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
二〇二六年三月三十一日