新华中证 A500 指数增强型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：新华基金管理股份有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：二〇二六年八月二十八日

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。

基金托管人兴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 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
2 基金简介 6
2.1 基金基本情况 6
2.2 基金产品说明 6
2.3 基金管理人和基金托管人 6
2.4 信息披露方式 7
2.5 其他相关资料 7
3 主要财务指标和基金净值表现 7
3.1 主要会计数据和财务指标 7
3.2 基金净值表现 8
4 管理人报告 9
4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 12
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 12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 14
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 14
5 托管人报告 14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 14
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 15
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 15
6 半年度财务会计报告（未经审计） 15
6.1 资产负债表 15
6.2 利润表 16
6.3 净资产变动表 17
6.4 报表附注 19
7 投资组合报告 36
7.1 期末基金资产组合情况 36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 43
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 43
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 43
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 43
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 43

7.10 本基金投资股指期货的投资政策 43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 43
7.12 投资组合报告附注 44
8 基金份额持有人信息 45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 45
9 开放式基金份额变动 46
10 重大事件揭示 46
10.1 基金份额持有人大会决议 46
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 46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 46
10.4 基金投资策略的改变 46
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 46
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 47
10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 47
10.8 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 47
10.9 其他重大事件 48
11 影响投资者决策的其他重要信息 49
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 49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 49
12 备查文件目录 49
12.1 备查文件目录 49
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	新华中证 A500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	新华中证 A500 指数增强	
基金主代码	023494	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 6 月 27 日	
基金管理人	新华基金管理股份有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	48,313,839.60 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	新华中证 A500 指数增强 A	新华中证 A500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	023494	023495
报告期末下属分级基金的份额总额	19,777,655.37 份	28,536,184.23 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型股票基金，采取量化方法进行组合管理，力争在控制跟踪误差的基础上，追求获得超越标的指数的回报。
投资策略	本基金的股票投资策略以指数成份股权重为基础，结合量化的选股模型、风险控制模型、流动性控制模型而形成综合的量化指数增强策略体系。本基金的主要投资策略包括：股票投资策略、港股通标的股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、可转换债券、可交换债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货、国债期货交易策略、参与融资及转融通证券出借业务策略等。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金还可投资港股通标的股票,需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数类似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		新华基金管理股份有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	齐岩	冯萌
	联系电话	010-68779688	021-52629999-213310
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	fengmeng@cib.com.cn
客户服务电话		4008198866	95561

传真	010-68779528	021-62159217
注册地址	重庆市江北区聚贤岩广场6号力帆中心2号楼19层	福建省福州市台江区江滨中大道398号兴业银行大厦
办公地址	重庆市江北区聚贤岩广场6号力帆中心2号楼19层,北京市西城区平安里西大街26号新时代大厦9层、11层	上海市浦东新区银城路167号4楼
邮政编码	400010	200120
法定代表人	银国宏	吕家进

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.ncfund.com.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人、基金托管人的办公地

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	新华基金管理股份有限公司	重庆市江北区聚贤岩广场 6 号力帆中心 2 号办公楼 19 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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）**	
	新华中证 A500 指数增强 A	新华中证 A500 指数增强 C
本期已实现收益	2,197,831.26	3,743,715.73
本期利润	2,953,495.50	4,611,766.10
加权平均基金份额本期利润	0.1486	0.1381
本期加权平均净值利润率	12.35%	11.53%
本期基金份额净值增长率	12.16%	11.93%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2026 年 6 月 30 日)**	
	新华中证 A500 指数增强 A	新华中证 A500 指数增强 C
期末可供分配利润	4,713,244.76	6,657,022.14
期末可供分配基金份额利润	0.2383	0.2333
期末基金资产净值	25,036,771.47	35,978,089.20

期末基金份额净值	1.2659	1.2608
3.1.3 累计期末指标	**报告期末(2026 年 6 月 30 日)**	
	新华中证 A500 指数增强 A	新华中证 A500 指数增强 C
基金份额累计净值增长率	26.59%	26.08%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2、以上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（例如基金申购费赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

新华中证 A500 指数增强 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	10.22%	1.30%	13.54%	1.34%	-3.32%	-0.04%
过去六个月	12.16%	1.18%	11.34%	1.22%	0.82%	-0.04%
过去一年	26.60%	0.99%	34.41%	1.09%	-7.81%	-0.10%
自基金合同生效起至今	26.59%	0.99%	34.85%	1.08%	-8.26%	-0.09%

新华中证 A500 指数增强 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	10.11%	1.30%	13.54%	1.34%	-3.43%	-0.04%
过去六个月	11.93%	1.18%	11.34%	1.22%	0.59%	-0.04%
过去一年	26.09%	0.99%	34.41%	1.09%	-8.32%	-0.10%
自基金合同生效起至今	26.08%	0.99%	34.85%	1.08%	-8.77%	-0.09%

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

新华中证 A500 指数增强型证券投资基金

份额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 6 月 27 日至 2026 年 6 月 30 日）

新华中证 A500 指数增强 A



新华中证 A500 指数增强 C



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

新华基金管理股份有限公司经中国证券监督管理委员会批复，于 2004 年 12 月 9 日注册成立。注册地为重庆市，是我国西部首家公募基金管理公司。

截至 2026 年 6 月 30 日，新华基金管理股份有限公司旗下管理着五十五只开放式基金，即新华优选分红混合型证券投资基金、新华优选成长混合型证券投资基金、新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金、新华钻石品质企业混合型证券投资基金、新华行业周期轮换混合型证券投资基金、新华中小市值优选混合型证券投资基金、新华优选消费混合型证券投资基金、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金、新华趋势领航混合型证券投资基金、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金、新华壹诺宝货币市场基金、新华增怡债券型证券投资基金、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金、新华中证环保产业指数证券投资基金、新华活期添利货币市场基金、新华增盈回报债券型证券投资基金、新华策略精选股票型证券投资基金、新华稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金、新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫回报混合型证券投资基金、新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金、新华科技创新主题灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金、新华双利债券型证券投资基金、新华丰利债券型证券投资基金、新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金、新华红利回报混合型证券投资基金、新华安享多裕定期开放灵活配置混合型证券投资基金、新华恒稳添利债券型证券投资基金、新华鑫日享中短债债券型证券投资基金、新华聚利债券型证券投资基金、新华鼎利债券型证券投资基金、新华沪深 300 指数增强型证券投资基金、新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金、新华景气行业混合型证券投资基金、新华安享惠融 88 个月定期开放债券型证券投资基金、新华利率债债券型证券投资基金、新华行业龙头主题股票型证券投资基金、新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金、新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金、新华中债 1-5 年农发行债券指数证券投资基金、新华中债 0-3 年政策性金融债指数证券投资基金、新华中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金、新华中证 A500 指数增强型证券投资基金、新华中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、新华科技优选混合型发起式证券投资基金、新华低碳经济混合型发起式证券投资基金、新华医疗创新混合型发起式证券投资基金、新华大盘成长量化选股混合型发起式证券投资基金、新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、新华锦利债券型证券投资基金、新华科技甄选混合型发起式证券投资基金、新华数字经济混合型发起式证券投资基金、新华中证科创创业 50 指数型证券投资基金。

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		
邓岳	本基金基金经理，指数与量化投资部总监，新华中证环保产业指数证券投资基金基金经理、新华沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理、新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理、新华中证科创创业 50 指数型证券投资基金基金经理。	2025-06-27	-	17	信息与信号处理专业硕士，曾任北京红色天时金融科技有限公司量化研究员，国信证券股份有限公司量化研究员，光大富尊投资有限公司量化研究员、投资经理，盈融达投资（北京）有限公司投资经理。
陈熵	本基金基金经理助理，新华中证环保产业指数证券投资基金基金经理助理、新华沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理助理、新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理、新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、新华中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理助理、新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理助理。	2025-07-07	-	8	计算机专业博士，曾任华润元大基金管理有限公司量化研究员、专户投资经理助理、投资经理。

注：1、首任基金经理，任职日期指基金合同生效日，离任日期指根据公司决定确定的解聘日期。

2、非首任基金经理，任职日期和离任日期均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

3、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》、《基金从业人员管理规则》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

本报告期末不存在基金经理同时兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期，新华基金管理股份有限公司作为新华中证 A500 指数增强型证券投资基金的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度，通过制度、流程、系统和技术手段落实公平交易原则，公平对待旗下管理的所有投资组合。本报告期，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规或对基金财产造成损失的异常交易行为；本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发生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%情形。

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

2026 年上半年，市场整体震荡，波动较大。上证指数再创新高，最高 4258.86 点，随后震荡回调。全市场日均交易额超过 2.5 万亿，整体交易热度继续升高。宽基指数中，偏中小盘的中证 500 和中证 1000 涨幅超过 15%，偏大盘的沪深 300 和更小盘的中证 2000 涨幅不超过 10%，呈现出中间高两头弱的分化格局。其他风格上，中证红利指数为代表的红利风格与市场整体走势反向，中证红利、红利低波指数跌幅在 10%附近，表现远落后于宽基指数。行业层面更是冰火两重天，30 个中信行业中，仅 9 个行业收益为正，排在前列的电子、通信，涨幅都超过 70%，其他行业收益都远远落后于这两个行业，表现较差的消费者服务、综合金融涨幅都在-30%附近。从中可以看出，上半年市场主线就是科技。科技的大行情除了受益于本轮 AI 技术大发展，也和中国的政策导向从传统制造业，转向科技创新有非常重大的关系，科技创新有望成为中国经济新的发展动力。

上半年美伊冲突对全球带来了较大的冲击，油价的上下波动幅度很大，给全球实体经济和金融市场都带来了巨大的影响。后期美伊虽然签订了谅解备忘录出现了阶段性缓和，但很快又恢复军事摩擦，油价也随着冲突的激烈程度而上下波动。但美国自身有通胀和债务的压力，对降油价和降息

的诉求很强烈，且美国对伊朗短期内难以实现既定战略目标，因此，双方短期内大幅升级战争烈度的概率相对不大，对市场的影响相比战争初期在逐渐减小。

上半年 PPI 和 CPI 同比全面转正，通缩局面逐渐扭转，前 6 月出口依然维持同比高增长，经济数据利好逐渐增多，市场对中国经济复苏的信心有所提振。

美元兑人民币汇率依旧持续下跌，2 季度再创新低，实际上人民币相对主要国际货币都是升值的，A 股对国际资金吸引力在持续加大，海外资金有可能是 A 股新的资金增量来源。

本基金为指数增强基金，标的指数为中证 A500 指数，投资目标为在有效控制跟踪误差的基础上，争取获得超过标的指数的收益。

2026 年上半年，指数增强主要采用量化选股的投资策略。其中量化选股策略主要基于多因子模型，综合采用估值、成长等多个大类的因子构建模型，整体模型符合 A 股市场的长期投资逻辑。

2026 年上半年累计实现净值收益率 12.16%（A 类份额），同期业绩比较基准收益 11.34%，相对业绩比较基准超额收益 0.82%，超额收益不明显。上半年 A 股市场风格比较极致，量化策略因为采用多种因子构建组合，整体属性偏均衡，在这种极致行情中获得较好的超额收益难度较大，希望接下来继续努力，争取能为投资者持续获取超额收益。

未来本基金将不断优化量化选股模型，争取在维持与指数较小的跟踪误差的同时，获得超过指数的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 1.2659 元，本报告期份额净值增长率为 12.16%，同期业绩比较基准收益率为 11.34%；C 类基金份额净值为 1.2608 元，本报告期份额净值增长率为 11.93%，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

7 月以来，市场调整幅度很大，主要原因是市场涨了很久，幅度也很大，本身就处于情绪不稳的高位区间，再叠加韩国股市去杠杆式下跌、美伊冲突再起、担忧美国云厂商巨头资本开支不及预期、大型 IPO 恐慌等内外部因素，市场无视多数上市公司财报与业绩预告的亮眼表现，走出一波情绪性下跌。大幅下跌消化了前期高位的焦虑情绪，让市场估值水平显著下降，也给后续的走势创造了更大的空间。

短期的影响因素终将过去，对未来市场的判断仍然应该基于对中长期经济和科技发展的判断。本轮行情，最核心的赛道就是以 AI 代表的科技相关的行业，所以，本轮行情能否回到慢牛的路径上，关键就是对以 AI 为代表的科技行业的未来有没有信心。如果看得是远期的行业发展，AI 的大逻辑

依然是没有问题的。就像上一轮手机互联网大发展，当时也有各种质疑和不信任，但我们现在的日常生活的很多应用都是那时候开始成型的。几大巨头平台企业，也都是那一轮开始发展壮大的。本轮 AI 也是一样，人类对“偷懒”和“省力”的追求是科技不断进步发展的核心驱动力，所以，AI 是符合人类本能的发展方向，未来必将能像手机互联网一样融入我们的日常生活，发展空间巨大。再加上中国已经开始大力推动科技创新，希望用科技创新来作为经济发展的新动力，中长期对科技赛道应该保持乐观。科技的不断创新也会不断促进经济的发展，也为股市重回慢牛的轨道，打好了基础。

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。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人设有估值委员会，负责对各类投资品种的估值方法、估值模型等进行研究和论证，组织制定和适时修订估值政策和程序。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。 本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本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，本托管人根据自身能够获取的数据和信息，依据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人根据自身能够获取的数据和信息，认真复核了本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，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：新华中证 A500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资　产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	3,482,071.46	2,425,149.99
结算备付金		-	1,673,940.56
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	57,715,168.70	58,742,133.99
其中：股票投资		57,715,168.70	58,742,133.99
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		694,175.92	535,772.67
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-

资产总计		61,891,416.08	63,376,997.21
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026 年 6 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		760,072.33	490,326.36
应付管理人报酬		39,764.76	41,528.16
应付托管费		4,970.61	5,191.02
应付销售服务费		12,060.34	13,529.56
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	59,687.37	111,808.22
负债合计		876,555.41	662,383.32
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	48,313,839.60	55,639,019.70
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	12,701,021.07	7,075,594.19
净资产合计		61,014,860.67	62,714,613.89
负债和净资产总计		61,891,416.08	63,376,997.21

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 48,313,839.60 份。其中：A 类基金份额净值 1.2659 元，基金份额 19,777,655.37 份；C 类基金份额净值 1.2608 元，基金份额 28,536,184.23 份。

6.2 利润表

会计主体：新华中证 A500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 6 月 27 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		**7,990,882.23**	**9,600.30**
1.利息收入		4,621.48	9,600.30
其中：存款利息收入	6.4.7.9	4,621.48	9,600.30
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-

买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		6,350,160.23	-
其中：股票投资收益	6.4.7.10	5,780,389.96	-
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	569,770.27	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,623,714.61	-
4.汇兑收益（损失以“一”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	12,385.91	-
减：二、营业总支出		425,620.63	34,744.35
1．管理人报酬		**253,650.01**	**21,643.05**
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2．托管费		31,706.27	2,705.38
3．销售服务费		79,417.45	8,017.00
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7．税金及附加		-	-
8．其他费用	6.4.7.20	60,846.90	2,378.92
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**7,565,261.60**	**-25,144.05**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**7,565,261.60**	**-25,144.05**
五、其他综合收益的税后净额		**-**	**-**
六、综合收益总额		**7,565,261.60**	**-25,144.05**

6.3 净资产变动表

会计主体：新华中证 A500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资	55,639,019.70	-	7,075,594.19	62,714,613.89

产				
二、本期期初净资产	55,639,019.70	-	7,075,594.19	62,714,613.89
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-7,325,180.10	-	5,625,426.88	-1,699,753.22
（一）、综合收益总额	-	-	7,565,261.60	7,565,261.60
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-7,325,180.10	-	-1,939,834.72	-9,265,014.82
其中：1.基金申购款	67,334,235.03	-	13,737,611.17	81,071,846.20
2.基金赎回款	-74,659,415.13	-	-15,677,445.89	-90,336,861.02
（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	48,313,839.60	-	12,701,021.07	61,014,860.67
项目		**上年度可比期间 2025 年 6 月 27 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日**		
	实收基金	**其他综合收益（若有）**	**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	329,163,523.60	-	-	329,163,523.60
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-	-25,144.05	-25,144.05
（一）、综合收益总额	-	-	-25,144.05	-25,144.05
（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）	-	-	-	-
其中：1.基金申购	-	-	-	-

款				
2.基金赎回款	-	-	-	-
（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	329,163,523.60	-	-25,144.05	329,138,379.55

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：

基金管理人负责人：银国宏，主管会计工作负责人：王宇成，会计机构负责人：涂运华

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

新华中证 A500 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2025]263 号文的核准，由新华基金管理股份有限公司向社会公开募集，基金合同于 2025 年 6 月 27 日正式生效，首次设立募集规模为 329,163,523.60 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期，本基金的基金管理人为新华基金管理股份有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则--基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、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》、《新华中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注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

本基金编制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本报告期的财务状况、经营成果和净资产变动情况等相关信息。

6.4.4本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计估计与最近一期年度报告相一致，所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2025]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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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，继续免征增值税直至债券到期。

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

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

（4）基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

6.4.7重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	2,306,312.93
等于：本金	2,306,196.04
加：应计利息	116.89
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	1,175,758.53
等于：本金	1,175,716.26
加：应计利息	42.27
合计	3,482,071.46

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 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		53,841,558.75	-	57,715,168.70	3,873,609.95
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		53,841,558.75	-	57,715,168.70	3,873,609.95

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

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 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	-
其他应付款	180.00
应付信息披露费	39,671.58
应付审计费	19,835.79
合计	59,687.37

6.4.7.7 实收基金

新华中证 A500 指数增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	19,387,116.37	19,387,116.37
本期申购	19,626,266.47	19,626,266.47
本期赎回（以“-”号填列）	-19,235,727.47	-19,235,727.47
本期末	19,777,655.37	19,777,655.37

新华中证 A500 指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	36,251,903.33	36,251,903.33
本期申购	47,707,968.56	47,707,968.56
本期赎回（以“-”号填列）	-55,423,687.66	-55,423,687.66
本期末	28,536,184.23	28,536,184.23

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

新华中证 A500 指数增强 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	2,431,095.12	63,562.00	2,494,657.12
本期期初	2,431,095.12	63,562.00	2,494,657.12
本期利润	2,197,831.26	755,664.24	2,953,495.50
本期基金份额交易产生的变动数	84,318.38	-273,354.90	-189,036.52
其中：基金申购款	3,983,966.48	-23,723.76	3,960,242.72
基金赎回款	-3,899,648.10	-249,631.14	-4,149,279.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,713,244.76	545,871.34	5,259,116.10

新华中证 A500 指数增强 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	4,461,766.36	119,170.71	4,580,937.07
本期期初	4,461,766.36	119,170.71	4,580,937.07
本期利润	3,743,715.73	868,050.37	4,611,766.10
本期基金份额交易产生的变动数	-1,548,459.95	-202,338.25	-1,750,798.20
其中：基金申购款	9,538,280.79	239,087.66	9,777,368.45
基金赎回款	-11,086,740.74	-441,425.91	-11,528,166.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,657,022.14	784,882.83	7,441,904.97

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	3,808.51
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	797.84
结算备付金利息收入	-
其他	15.13
合计	4,621.48

注：其他存款利息收入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

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	173,162,548.12
减：卖出股票成本总额	167,209,162.51
减：交易费用	172,995.65
买卖股票差价收入	5,780,389.96

6.4.7.11 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.12 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	569,770.27
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	569,770.27

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	1,623,714.61
——股票投资	1,623,714.61
——债券投资	-
——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	1,623,714.61

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	12,385.91
合计	12,385.91

6.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行汇划费	1,339.53
合计	60,846.90

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，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2资产负债表日后事项

截至财务报告批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期内本基金不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
兴业银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
新华基金管理股份有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
金融街证券股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构

注：1、自 2025 年 9 月 9 日起，公司控股股东恒泰证券股份有限公司更名为金融街证券股份有

限公司。

2、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年6月27日（基金合同生效日）至2025年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
金融街证券股份有限公司	40,748,309.09	12.07%	-	-

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
金融街证券股份有限公司	7,813.82	12.07%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025年6月27日（基金合同生效日）至2025年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
金融街证券股份有限公司	-	-	-	-

注：1、上述佣金按合同约定的佣金率计算。

2、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，针对被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；针对其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

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1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年6月27日（基金合同生效日）至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	253,650.01	21,643.05
其中：应支付销售机构的客户维护费	116,348.29	10,022.82
应支付基金管理人的净管理费	137,301.72	11,620.23

注：1、基金管理费按前一日基金资产净值 0.8%的年费率计提，每日计提，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金管理费=前一日基金资产净值×年费率/当年天数；

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年6月27日（基金合同生效日）至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	31,706.27	2,705.38

注：基金托管费按前一日基金资产净值 0.1%的年费率计提，每日计提，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日基金资产净值×年费率/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1月1日至2026年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	新华中证 A500 指数增强 A	新华中证 A500 指数增强 C	合计
兴业银行股份有限公	-	17,327.56	17,327.56

司			
新华基金管理股份有限公司	-	3,742.09	3,742.09
金融街证券股份有限公司	-	4,296.81	4,296.81
合计	-	25,366.46	25,366.46
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025年6月27日（基金合同生效日）至2025年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	新华中证A500指数增强A	新华中证A500指数增强C	合计
兴业银行股份有限公司	-	1,472.93	1,472.93
金融街证券股份有限公司	-	564.67	564.67
合计	-	2,037.60	2,037.60

注：本基金 C 类基金的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.4%的年费率计提，每日计提，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金销售服务费=前一日 C 类基金资产净值×年费率/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期未发生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。

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

本基金本报告期未发生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。

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

报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

新华中证 A500 指数增强 C

份额单位：份

关联方名称	新华中证A500指数增强C本期末 2026年6月30日		新华中证A500指数增强C上年度末 2025年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的

		比例		比例
金融街证券股份有限公司（自营）	1,490,000.00	5.22%	1,600,000.00	4.41%

注：对于分级基金，下属分级份额占比的分母采用各自级别的份额。

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1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年6月27日（基金合同生效日）至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	2,306,312.93	3,808.51	9,162,265.50	9,600.30

注：本基金的上述银行存款由基金托管人兴业银行股份有限公司保管，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

本基金本报告期在承销期内未参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 6 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券产生的流通受限证券。

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	重大事项或临时停牌	879.53	2026-07-13	890.99	1,300.00	620,562.65	1,143,389.00	-

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

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人建立了以董事会下设的审计委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的风险管理架构体系。

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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人通过严格的投资备选库制度、交易对手库管理和分散化投资方式防范信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级列示的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级列示的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。

除卖出回购金融资产款余额（计息但该利息金额不重大）以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等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组合的流动性指标进行持续的监测和分析。本报告期内，本基金资产的投资比例符合基金流动性风险管理的相关规定，流动性风险较低。

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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 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	3,482,071.46	-	-	-	3,482,071.46
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	57,715,168.70	57,715,168.70
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-

债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	694,175.92	694,175.92
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,482,071.46	-	-	58,409,344.62	61,891,416.08
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	760,072.33	760,072.33
应付管理人报酬	-	-	-	39,764.76	39,764.76
应付托管费	-	-	-	4,970.61	4,970.61
应付销售服务费	-	-	-	12,060.34	12,060.34
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	59,687.37	59,687.37
负债总计	-	-	-	876,555.41	876,555.41
利率敏感度缺口	3,482,071.46	-	-	57,532,789.21	61,014,860.67
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	2,425,149.99	-	-	-	2,425,149.99
结算备付金	1,673,940.56	-	-	-	1,673,940.56
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	58,742,133.99	58,742,133.99
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-

其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	535,772.67	535,772.67
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,099,090.55	-	-	59,277,906.66	63,376,997.21
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	490,326.36	490,326.36
应付管理人报酬	-	-	-	41,528.16	41,528.16
应付托管费	-	-	-	5,191.02	5,191.02
应付销售服务费	-	-	-	13,529.56	13,529.56
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	111,808.22	111,808.22
负债总计	-	-	-	662,383.32	662,383.32
利率敏感度缺口	4,099,090.55	-	-	58,615,523.34	62,714,613.89

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末及上年度末，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金可以持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

本报告期末及上年度末，本基金未持有以外币计价的资产或负债，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

在其他价格风险分析中，本基金管理人主要分析市场价格风险的影响。市场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的股票，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

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 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	57,715,168.70	94.59	58,742,133.99	93.67
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	57,715,168.70	94.59	58,742,133.99	93.67

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩基准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 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	3,359,311.39	2,610,500.43
	业绩比较基准下降 5%	-3,359,311.39	-2,610,500.43

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 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	56,571,779.70	58,088,010.99
第二层次	1,143,389.00	654,123.00
第三层次	-	-
合计	57,715,168.70	58,742,133.99

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

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

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	57,715,168.70	93.25
	其中：股票	57,715,168.70	93.25
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-

	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,482,071.46	5.63
8	其他各项资产	694,175.92	1.12
9	合计	61,891,416.08	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

7.2.1.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,582,288.00	2.59
C	制造业	36,893,147.90	60.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	121,856.00	0.20
E	建筑业	389,298.00	0.64
F	批发和零售业	673,736.00	1.10
G	交通运输、仓储和邮政业	1,045,797.00	1.71
H	住宿和餐饮业	124,131.00	0.20
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,858,548.20	3.05
J	金融业	5,482,723.00	8.99
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	280,720.00	0.46
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,135,222.00	1.86
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	49,587,467.10	81.27

7.2.1.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

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	235,080.80	0.39
B	采矿业	295,320.00	0.48
C	制造业	4,932,649.80	8.08
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	293,820.00	0.48
G	交通运输、仓储和邮政业	327,236.00	0.54
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	213,372.00	0.35
J	金融业	156,140.00	0.26
K	房地产业	318,240.00	0.52
L	租赁和商务服务业	163,123.00	0.27
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	900,480.00	1.48
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	292,240.00	0.48
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	8,127,701.60	13.32

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净

					值比例（%）
1	300308	中际旭创	2,700	3,429,000.00	5.62
2	300750	宁德时代	6,400	2,515,264.00	4.12
3	603986	兆易创新	2,600	2,119,000.00	3.47
4	300502	新易盛	3,080	1,869,560.00	3.06
5	600519	贵州茅台	1,500	1,778,235.00	2.91
6	601318	中国平安	25,800	1,231,692.00	2.02
7	600036	招商银行	32,700	1,160,850.00	1.90
8	600030	中信证券	40,400	1,160,692.00	1.90
9	688072	拓荆科技	1,300	1,143,389.00	1.87
10	600183	生益科技	6,500	1,127,100.00	1.85
11	300223	北京君正	4,400	1,095,160.00	1.79
12	601398	工商银行	140,400	992,628.00	1.63
13	002384	东山精密	3,300	865,755.00	1.42
14	000651	格力电器	23,000	862,500.00	1.41
15	002156	通富微电	11,000	834,570.00	1.37
16	688002	睿创微纳	5,346	826,972.74	1.36
17	300408	三环集团	4,200	700,980.00	1.15
18	002475	立讯精密	9,400	661,760.00	1.08
19	002414	高德红外	48,000	636,480.00	1.04
20	000938	紫光股份	22,000	634,920.00	1.04
21	002185	华天科技	26,900	600,139.00	0.98
22	002266	浙富控股	116,900	591,514.00	0.97
23	000001	平安银行	56,800	570,840.00	0.94
24	603606	东方电缆	13,680	567,856.80	0.93
25	002497	雅化集团	27,300	556,101.00	0.91
26	600323	瀚蓝环境	19,800	543,708.00	0.89
27	688111	金山办公	2,544	541,999.20	0.89
28	600104	上汽集团	55,400	540,704.00	0.89
29	000807	云铝股份	24,200	535,788.00	0.88
30	000408	藏格矿业	7,600	526,832.00	0.86
31	300573	兴齐眼药	12,655	515,817.80	0.85
32	002415	海康威视	15,000	513,000.00	0.84
33	300604	长川科技	1,500	512,130.00	0.84
34	600150	中国船舶	14,400	486,576.00	0.80
35	002532	天山铝业	44,000	472,120.00	0.77
36	002049	紫光国微	5,100	452,625.00	0.74
37	600160	巨化股份	8,500	450,585.00	0.74
38	002463	沪电股份	2,900	443,120.00	0.73
39	601899	紫金矿业	17,000	427,380.00	0.70
40	000100	TCL 科技	72,800	423,696.00	0.69
41	600522	中天科技	6,700	406,556.00	0.67
42	002444	巨星科技	12,900	401,190.00	0.66

43	600352	浙江龙盛	32,800	397,208.00	0.65
44	002558	巨人网络	14,300	394,108.00	0.65
45	601877	正泰电器	15,700	393,599.00	0.65
46	601668	中国建筑	89,700	389,298.00	0.64
47	000425	徐工机械	47,900	387,511.00	0.64
48	600941	中国移动	4,400	378,972.00	0.62
49	601857	中国石油	43,200	374,976.00	0.61
50	600316	洪都航空	13,200	368,808.00	0.60
51	601288	农业银行	60,300	366,021.00	0.60
52	002271	东方雨虹	29,500	350,165.00	0.57
53	600998	九州通	72,400	339,556.00	0.56
54	601607	上海医药	21,700	334,180.00	0.55
55	600570	恒生电子	15,600	330,564.00	0.54
56	688599	天合光能	23,243	328,191.16	0.54
57	000975	山金国际	19,300	328,100.00	0.54
58	600887	伊利股份	13,200	316,272.00	0.52
59	601872	招商轮船	17,900	314,503.00	0.52
60	600233	圆通速递	19,800	311,850.00	0.51
61	600741	华域汽车	20,000	310,400.00	0.51
62	300919	中伟新材	6,900	301,875.00	0.49
63	601233	桐昆股份	13,800	298,770.00	0.49
64	002389	航天彩虹	16,200	287,874.00	0.47
65	600535	天士力	21,700	287,091.00	0.47
66	002756	永兴材料	5,000	283,200.00	0.46
67	002027	分众传媒	58,000	280,720.00	0.46
68	605117	德业股份	2,640	280,315.20	0.46
69	000933	神火股份	13,200	279,840.00	0.46
70	000960	锡业股份	6,500	277,485.00	0.45
71	601633	长城汽车	17,500	264,075.00	0.43
72	600885	宏发股份	7,600	262,124.00	0.43
73	000333	美的集团	3,400	256,802.00	0.42
74	300394	天孚通信	840	254,251.20	0.42
75	601168	西部矿业	9,300	252,402.00	0.41
76	601021	春秋航空	5,300	241,574.00	0.40
77	000683	博源化工	38,800	223,488.00	0.37
78	688617	惠泰医疗	1,200	217,872.00	0.36
79	601360	三六零	24,500	212,905.00	0.35
80	601225	陕西煤业	9,800	199,430.00	0.33
81	601111	中国国航	29,400	177,870.00	0.29
82	300661	圣邦股份	1,200	172,176.00	0.28
83	600989	宝丰能源	8,100	164,673.00	0.27
84	002050	三花智控	3,500	153,405.00	0.25
85	000338	潍柴动力	5,100	138,975.00	0.23
86	002459	晶澳科技	16,200	131,220.00	0.22

87	600754	锦江酒店	6,900	124,131.00	0.20
88	600008	首创环保	44,800	121,856.00	0.20

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	603588	高能环境	46,900.00	900,480.00	1.48
2	300628	亿联网络	17,100.00	578,322.00	0.95
3	301536	星宸科技	4,200.00	540,582.00	0.89
4	688309	恒誉环保	8,685.00	528,742.80	0.87
5	688766	普冉股份	500.00	383,300.00	0.63
6	001309	德明利	400.00	377,160.00	0.62
7	601156	东航物流	20,300.00	327,236.00	0.54
8	000708	中信特钢	25,800.00	325,596.00	0.53
9	001914	招商积余	39,000.00	318,240.00	0.52
10	000049	德赛电池	13,200.00	308,484.00	0.51
11	600971	恒源煤电	42,800.00	295,320.00	0.48
12	300592	华凯易佰	16,600.00	293,820.00	0.48
13	603882	金域医学	13,000.00	292,240.00	0.48
14	300769	德方纳米	3,800.00	252,700.00	0.41
15	300970	华绿生物	12,860.00	235,080.80	0.39
16	688378	奥来德	3,600.00	223,200.00	0.37
17	300529	健帆生物	14,200.00	218,680.00	0.36
18	688258	卓易信息	1,800.00	213,372.00	0.35
19	301246	宏源药业	7,700.00	207,130.00	0.34
20	002947	恒铭达	2,600.00	197,730.00	0.32
21	603013	亚普股份	11,300.00	178,427.00	0.29
22	603187	海容冷链	15,100.00	173,499.00	0.28
23	603456	九洲药业	12,400.00	169,384.00	0.28
24	002818	富森美	15,700.00	163,123.00	0.27
25	600999	招商证券	7,400.00	156,140.00	0.26
26	000951	中国重汽	7,900.00	154,129.00	0.25
27	603998	方盛制药	12,800.00	115,584.00	0.19

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	601318	中国平安	2,640,839.00	4.21

2	600036	招商银行	2,208,850.00	3.52
3	300750	宁德时代	2,107,717.00	3.36
4	300308	中际旭创	1,643,862.00	2.62
5	002497	雅化集团	1,590,565.00	2.54
6	601857	中国石油	1,586,411.00	2.53
7	300502	新易盛	1,555,857.00	2.48
8	603986	兆易创新	1,520,444.00	2.42
9	000651	格力电器	1,496,531.00	2.39
10	002493	荣盛石化	1,481,063.00	2.36
11	601899	紫金矿业	1,464,008.00	2.33
12	600499	科达制造	1,417,412.00	2.26
13	600089	特变电工	1,399,780.00	2.23
14	000001	平安银行	1,378,284.00	2.20
15	600519	贵州茅台	1,365,244.00	2.18
16	600900	长江电力	1,360,290.00	2.17
17	688188	柏楚电子	1,354,328.42	2.16
18	002925	盈趣科技	1,340,037.00	2.14
19	002384	东山精密	1,274,971.00	2.03
20	600150	中国船舶	1,228,174.00	1.96

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以数量）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	600036	招商银行	2,302,452.00	3.67
2	601318	中国平安	2,171,678.00	3.46
3	300750	宁德时代	2,084,150.00	3.32
4	601899	紫金矿业	2,000,652.00	3.19
5	601872	招商轮船	1,910,685.00	3.05
6	600089	特变电工	1,831,552.00	2.92
7	601288	农业银行	1,781,150.00	2.84
8	601857	中国石油	1,755,386.00	2.80
9	601628	中国人寿	1,695,861.00	2.70
10	600519	贵州茅台	1,673,093.00	2.67
11	601398	工商银行	1,623,047.00	2.59
12	002156	通富微电	1,616,200.00	2.58
13	600900	长江电力	1,578,094.00	2.52
14	600499	科达制造	1,563,172.00	2.49
15	002493	荣盛石化	1,525,686.00	2.43
16	002925	盈趣科技	1,461,630.00	2.33
17	688188	柏楚电子	1,459,640.70	2.33
18	000933	神火股份	1,457,276.00	2.32

19	000333	美的集团	1,448,679.00	2.31
20	300604	长川科技	1,423,326.00	2.27
21	000157	中联重科	1,411,909.30	2.25
22	300308	中际旭创	1,392,385.00	2.22
23	000100	TCL 科技	1,391,844.00	2.22
24	002049	紫光国微	1,346,901.00	2.15

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	164,558,482.61
卖出股票收入（成交）总额	173,162,548.12

注：“买入股票的成本（成交）总额”与“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以数量）填列，不考虑相关费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本报告期末，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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	694,175.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	694,175.92

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	1,143,389.00	1.87	停牌

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(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
新华中证A500指数增强 A	308	64,213.17	0.00	0.00%	19,777,655.37	100.00%
新华中证A500指数增强 C	600	47,560.31	1,490,000.00	5.22%	27,046,184.23	94.78%
合计	908	53,209.07	1,490,000.00	3.08%	46,823,839.60	96.92%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	新华中证 A500 指数增强 A	108,563.80	0.55%
	新华中证 A500 指数增强 C	10,001.10	0.04%
	合计	118,564.90	0.25%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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	新华中证A500指数增强 A	0
	新华中证A500指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开	新华中证A500指数增强	10~50

放式基金	A	
	新华中证A500指数增强C	0
	合计	10~50

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	新华中证 A500 指数增强 A	新华中证 A500 指数增强 C
基金合同生效日（2025 年 6 月 27 日）基金份额总额	85,306,099.12	243,857,424.48
本报告期期初基金份额总额	19,387,116.37	36,251,903.33
本报告期基金总申购份额	19,626,266.47	47,707,968.56
减：本报告期基金总赎回份额	19,235,727.47	55,423,687.66
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	19,777,655.37	28,536,184.23

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

基金管理人于 2026 年 2 月 25 日发布公告，自 2026 年 2 月 24 日起张鹏先生担任公司副总经理兼财务负责人，徐端骞先生离任公司副总经理兼首席信息官。基金管理人于 2026 年 4 月 21 日发布公告，自 2026 年 4 月 20 日起王宇成先生担任公司副总经理兼首席信息官。上述事项经基金管理人董事会审议通过，并按照现行法律法规履行备案程序。

报告期内托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未有涉及基金管理人、基金财产的诉讼。

报告期内无涉及本基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期本基金未持有基金。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未有改聘会计师事务所的情况。

10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.7.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受到调查或处罚等情况。

10.7.2 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无受到调查或处罚等情况。

10.7.3 托管人受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

10.7.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人相关从业人员在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

10.8 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

10.8.1 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	
国海证券	2	296,972,721.64	87.93%	56,941.95	87.93%	-
金融街证券	3	40,748,309.09	12.07%	7,813.82	12.07%	-
西南证券	2	-	-	-	-	-

注：一、交易单元的选择标准：

（一）基本情况：财务状况良好，财务指标符合证券公司监管要求；

（二）合规风控：公司治理完善，内部管理规范，内控制度健全；

（三）研究服务实力方面需满足以下条件：1、有较好的研究能力与行业分析能力，能够及时、全面地提供宏观经济、行业、市场走势及个股分析等高质量研究报与信息服务；2、能够根据本公司所管理基金的特定需求，提供专题研究报告；3、具备良好的服务意识，能够主动为公司投资业务开展、投资信息的交流及其他相关业务提供服务和支持。

（四）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足本基金证券交易的需要。

二、交易单元的选择程序：

（一）公司研究部根据上述标准对证券公司进行考察，确定合作的证券公司名单。

（二）公司与选定的证券经营机构签订交易单元席位租用协议。

三、本基金管理人已根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（证监会公告［2024］3号）及证券业协会测算结果，完成佣金动态调整工作。本部分数据统计时间区间与本报告的报告期一致，统计范围仅包括本基金。

10.8.2 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	
	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
国海证券	-	-	-	-	-	-
金融街证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-

10.9 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	新华基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年 4 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-01-22
2	新华中证 A500 指数增强型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-01-22
3	新华基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-02-25
4	新华基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-30
5	新华中证 A500 指数增强型证券投资基金 2025 年年度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-30
6	新华基金管理股份有限公司旗下基金 2026 年 1 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-21
7	新华中证 A500 指数增强型证券投资基金	管理人网站、中国证监会	2026-04-21

	2026 年第 1 季度报告	基金电子披露网站	
8	新华基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-21
9	新华基金管理股份有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务及后续投资者服务措施的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-06-01

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
个人	1	20260423-20260429，20260507-20260518，20260526-20260608，20260616-20260630	9,999,000.00	-	-	9,999,000.00	20.70%
产品特有风险							
1、巨额赎回的风险 持有基金份额比例较高的投资者大量赎回时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。 2、基金规模较小导致的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。 3、基金净值大幅波动的风险 持有基金份额比例较高的投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

（一）中国证监会准予新华中证 A500 指数增强型证券投资基金注册的文件

（二）《关于申请募集新华中证 A500 指数增强型证券投资基金之法律意见书》

（三）《新华中证 A500 指数增强型证券投资基金托管协议》

（四）《新华中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》

（五）《新华中证 A500 指数增强型证券投资基金招募说明书》（更新）

（六）基金管理人业务资格批件、营业执照

（七）基金托管人业务资格批件、营业执照

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站查阅。

新华基金管理股份有限公司
二〇二六年八月二十八日