

圆信永丰中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人:圆信永丰基金管理有限公司

基金托管人:国泰海通证券股份有限公司

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及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

基金托管人国泰海通证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2026年3月30日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所（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01月01日起至2025年12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	11
§4 管理人报告.....	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
§5 托管人报告.....	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
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.....	16
§6 审计报告.....	16
6.1 审计报告基本信息.....	16
6.2 审计报告的基本内容.....	16
§7 年度财务报表.....	19
7.1 资产负债表.....	19
7.2 利润表.....	21
7.3 净资产变动表.....	23
7.4 报表附注.....	25
§8 投资组合报告.....	59
8.1 期末基金资产组合情况.....	59
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	59
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.....	61
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	73
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	75
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.....	76
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.....	76

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.....	76
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	76
8.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	76
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	76
8.12	投资组合报告附注.....	76
§9	基金份额持有人信息	77
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	78
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	78
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.....	79
9.4	发起式基金发起资金持有份额情况.....	79
§10	开放式基金份额变动.....	80
§11	重大事件揭示.....	80
11.1	基金份额持有人大会决议	80
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	80
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	80
11.4	基金投资策略的改变	80
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	80
11.6	管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	81
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	81
11.8	其他重大事件.....	82
§12	影响投资者决策的其他重要信息	84
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	84
12.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	85
§13	备查文件目录.....	85
13.1	备查文件目录.....	85
13.2	存放地点	85
13.3	查阅方式	85

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	圆信永丰中证500指数增强发起	
基金主代码	013878	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年12月01日	
基金管理人	圆信永丰基金管理有限公司	
基金托管人	国泰海通证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	106,193,584.41份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	圆信永丰中证500指数增强发起A	圆信永丰中证500指数增强发起C
下属分级基金的交易代码	013878	013879
报告期末下属分级基金的份额总额	104,104,593.33份	2,088,991.08份

2.2 基金产品说明

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

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		圆信永丰基金管理有限公司	国泰海通证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王几高	帅芳
	联系电话	021-68033400	021-38677947
	电子邮箱	service@gtsfund.com.cn	tgrxp@tg.gtht.com
客户服务电话		4006070088	021-38917599-5
传真		021-68033401	021-50872603
注册地址		中国（福建）自由贸易试验区 厦门片区（保税港区）海景南 二路45号4楼402单元之175	中国（上海）自由贸易试验区 商城路618号
办公地址		上海市浦东新区陆家嘴环路1 233号汇亚大厦22层	上海市静安区新闻路669号博 华广场19楼
邮政编码		200120	200041
法定代表人		胡荣炜	朱健

注：因基金管理人业务发展需要，自2026年3月7日起，基金管理人的办公地址及直销中心地址变更为上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦22层，邮政编码变更为200120，联系电话变更为021-68033400，直销中心传真变更为021-68033401。基金管理人网站、客服热线、客服邮箱等均保持不变。

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	http://www.gtsfund.com.cn
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦22层

注：因基金管理人业务发展需要，自2026年3月7日起，基金管理人的办公地址及直销中心地址变更为上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦22层，基金年度报告备置地点同步变更为前述地址。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层
注册登记机构	圆信永丰基金管理有限公司	上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦22层

注：因业务发展需要，自2026年3月7日起，圆信永丰基金管理有限公司（注册登记机构）的办公地址变更为上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦22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		2024年		2023年	
	圆信永丰中证500指数增强发起A	圆信永丰中证500指数增强发起C	圆信永丰中证500指数增强发起A	圆信永丰中证500指数增强发起C	圆信永丰中证500指数增强发起A	圆信永丰中证500指数增强发起C
本期已实现收益	21,528,336.40	411,594.12	5,512,152.38	485,424.25	-7,267,909.65	-398,159.17
本期利润	26,887,470.20	1,012,779.27	2,755,590.96	244,202.36	-5,177,007.36	-208,035.62
加权平均基金份额本期利润	0.2311	0.1242	0.0312	0.0279	-0.0541	-0.0341

本期加权平均净值利润率	26.79%	15.38%	4.08%	3.58%	-6.51%	-4.11%
本期基金份额净值增长率	26.23%	25.83%	4.53%	4.22%	-7.79%	-8.07%
3.1.2 期末数据和指标	2025年末		2024年末		2023年末	
期末可供分配利润	1,411,213.68	2,375.42	-28,953,544.26	-5,358,471.18	-20,262,115.50	-1,183,410.90
期末可供分配基金份额利润	0.0136	0.0011	-0.1970	-0.2044	-0.2319	-0.2366
期末基金资产净值	105,515,807.01	2,091,366.50	117,997,657.05	20,855,068.21	67,112,653.69	3,817,742.24
期末基金份额净值	1.0136	1.0011	0.8030	0.7956	0.7682	0.7634
3.1.3 累计期末指标	2025年末		2024年末		2023年末	
基金份额累计净值增长率	1.36%	0.11%	-19.70%	-20.44%	-23.18%	-23.66%

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

注2：对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

注3：上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

圆信永丰中证500指数增强发起A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.65%	1.02%	0.71%	1.18%	1.94%	-0.16%
过去六个月	24.81%	0.96%	24.81%	1.11%	0.00%	-0.15%

过去一年	26.23%	1.12%	28.81%	1.20%	-2.58%	-0.08%
过去三年	21.67%	1.20%	26.25%	1.30%	-4.58%	-0.10%
自基金合同生效起至今	1.36%	1.22%	3.31%	1.29%	-1.95%	-0.07%

圆信永丰中证500指数增强发起C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.57%	1.02%	0.71%	1.18%	1.86%	-0.16%
过去六个月	24.61%	0.96%	24.81%	1.11%	-0.20%	-0.15%
过去一年	25.83%	1.12%	28.81%	1.20%	-2.98%	-0.08%
过去三年	20.56%	1.20%	26.25%	1.30%	-5.69%	-0.10%
自基金合同生效起至今	0.11%	1.21%	3.31%	1.29%	-3.20%	-0.08%

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

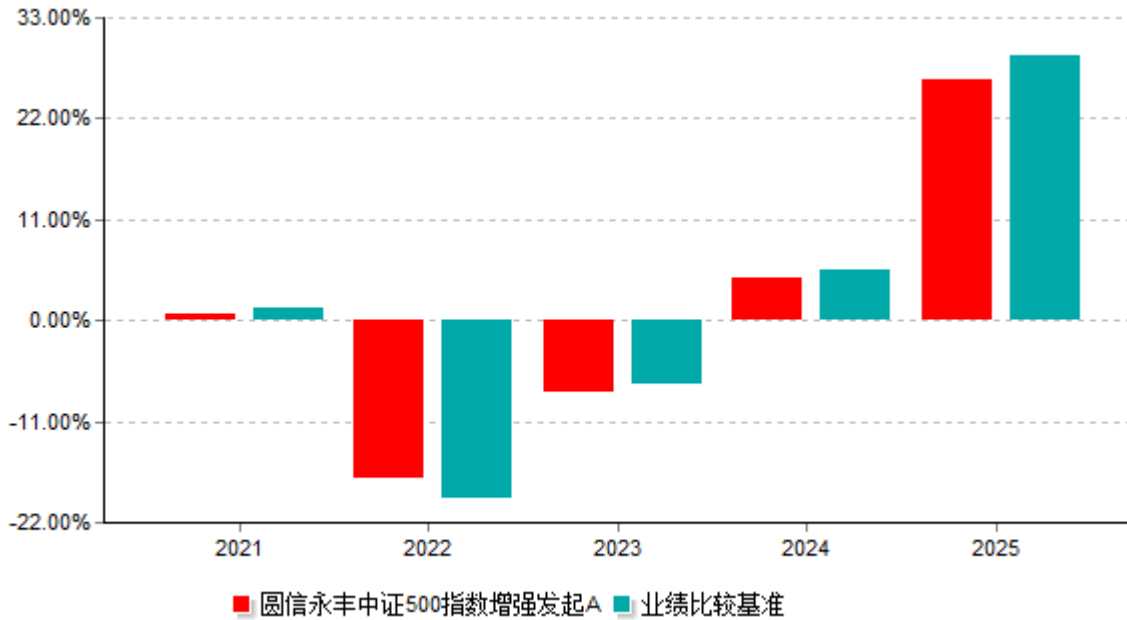
圆信永丰中证500指数增强发起A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2021年12月01日-2025年12月31日)



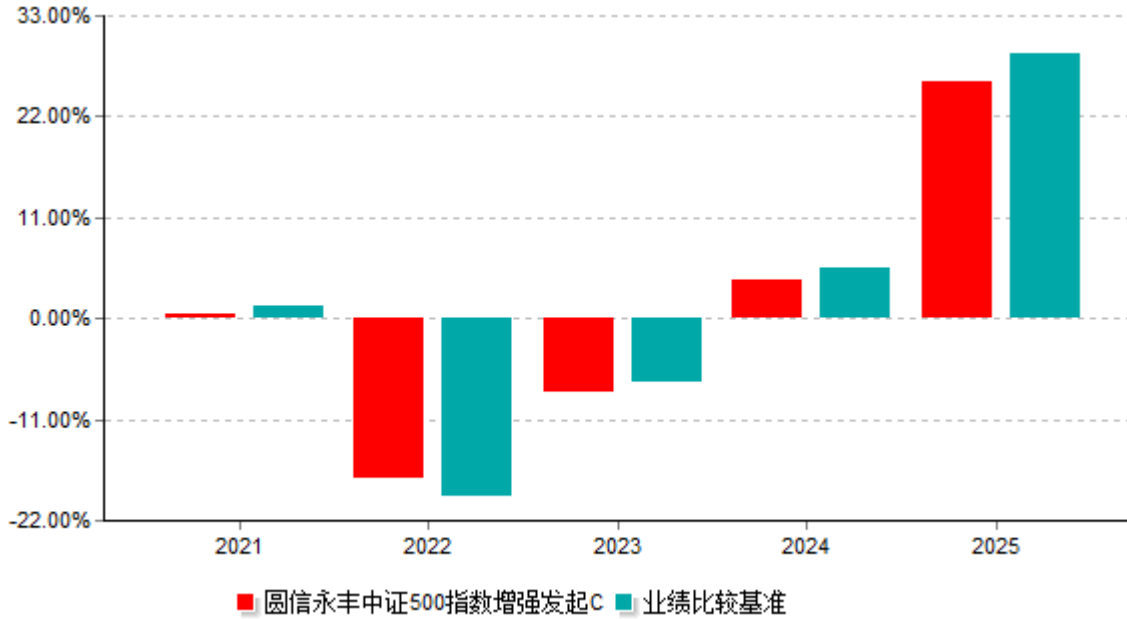
圆信永丰中证500指数增强发起C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2021年12月01日-2025年12月31日)



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：本基金合同生效日为2021年12月01日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。



注：本基金合同生效日为2021年12月01日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未发生利润分配。

§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

圆信永丰基金管理有限公司是经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”或“证监会”）证监许可[2013]1514号文批准，于2014年1月2日成立的合资基金管理公司。本公司由厦门国际信托有限公司与台湾永丰证券投资信托股份有限公司合资设立，持股比例分别为51%和49%，注册资本贰亿元人民币。公司注册地位于厦门，主要业务经营团队位于上海，是厦门首家证券投资基金管理公司，也是海西首家两岸合资的证券投资基金管理公司。

截止2025年12月31日，公司旗下共管理36只开放式基金产品，包括4只股票型基金、20只混合型基金、11只债券型基金和1只货币市场基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基	证券	说明
----	----	--------	----	----

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

注1：证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

注2：崔长峰的"任职日期"为基金合同生效之日。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

基金管理人各类基金资产、私募资产管理计划资产独立运作。对于交易所市场投资，本公司执行集中交易制度，确保不同投资组合在买卖同一证券时，按照价格优先、时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量；对于银行间市场投资，基金管

理人通过交易对手控制和询价机制，严格防范对手风险并抽检价格公允性；对于申购投资行为，基金管理人遵循价格优先、比例分配的原则，根据事前独立申报的价格和数量对交易结果进行公平分配。

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行上述公平交易制度和控制方法，开展公平交易工作。通过对不同投资组合之间的整体收益率差异、以及不同投资组合之间同向交易和反向交易的交易时机和交易价差等方面的监控分析，对以公司名义进行的一级市场申购方案和分配过程进行审核和监控等，公司未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

其中，在同向交易的监控和分析方面，根据法规要求，公司对不同投资组合的同日和临近交易日的同向交易行为进行监控，通过定期抽查前述的同向交易行为，定性分析交易时机、对比不同投资组合长期的交易趋势，重点关注任何可能导致不公平交易的情形。对于识别的异常情况，由相关投资组合经理对异常交易情况进行合理解释。同时，公司根据法规的要求，通过系统模块定期对连续四个季度内不同投资组合在不同时间窗内（T=1日、T=3日、T=5日）的同向交易价差进行分析，采用概率统计方法，重点关注不同投资组合之间同向交易溢价率均值是否为零的t检验，以及同向交易价格占优的交易次数占比分析。在一级市场证券申购和分配方面，事前对申购指令单进行审核监控，事后对以公司名义进行的申购报价单进行核查，确保分配结果符合公平交易的原则。

报告期内，通过前述分析方法，未发现公司旗下不同投资组合之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

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

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2025年，A股整体上涨。上证指数上涨18.41%，深证成指上涨29.87%，沪深300上涨17.66%，中证500上涨30.39%，中证1000上涨27.49%，中证2000上涨36.42%，中证红利下跌1.39%，万得微盘股日频等权指数上涨81.65%。表现较好的行业包括有色、通信、

电子、电力设备、机械设备等，表现较差的行业包括食品饮料、煤炭、美容护理、公用事业、交通运输等。中证500内相关风格指数的收益率如下：中证500成长（40.78%），中证500（30.39%），500等权全收益（29.35%），500现金流（29.18%），500质量（22.23%），中证500价值（17.20%），500红利低波（4.96%）。全年来看，成长风格非常突出，现金流、质量、价值、红利低波等风格指数的收益落后中证500指数收益。量化选股策略充分利用因子库的多维度信息，通常具备分散化持仓的特点，当股票收益过于集中成长等少数维度的风格时，量化策略面临一定挑战。操作上，我们结合市场环境的变化，淘汰了部分失效因子，开发了部分新因子，提升了因子库的有效性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末圆信永丰中证500指数增强发起A基金份额净值为1.0136元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为26.23%，同期业绩比较基准收益率为28.81%；截至报告期末圆信永丰中证500指数增强发起C基金份额净值为1.0011元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为25.83%，同期业绩比较基准收益率为28.81%。

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，国内外流动性保持充裕、物价水平触底回升、企业利润回升等都对指数形成支撑。随着过去一年市场的上涨，当前指数的估值较历史水平有所抬升，监管对于杠杆资金的管理也更加严格，但这些都不会改变A股长期慢牛的基础格局。结构上，预计成长方向将继续占优，但风格的波动有可能比过去有所加大，要注意风格之间的高低切换对量化策略的影响。

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

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2025年，基金管理人牢记“受人之托、代人理财”的初心，忠实履行“诚实守信、勤勉尽责”的职责。公司监察稽核工作以“提升合规服务、推进业务发展、保障稳健经营、提升内控水平、保障投资者合法权益”为总体目标，秉承以合规促进发展、以服务创造价值的理念，按照工作计划结合实际情况对公司各项业务进行全面的监察稽核工作，保障和促进公司各项业务合法合规运作。报告期内，基金管理人内部监察稽核工作贯穿三条主线：

1、契合法规变化，健全合规机制。报告期内，基金管理人积极做好以事前防范为主的合规管理工作，坚守合规底线不动摇。及时跟踪行业监管动向，结合新法规实施、

新监管要求落实以及公司业务发展的实际情况，推动和完善公司相关制度流程的建立、健全。

2、加强业务监控，防范合规风险。注重对核心领域的日常跟踪监测，强化对从业人员的行为管理，防范利益冲突。重视反洗钱工作，认真贯彻落实各项反洗钱监管要求。开展多样化的合规培训和宣导，提升合规氛围，强化从业人员合规意识。

3、深化内审稽核，提升内控有效性。通过内部监察稽核发现问题、解决问题、改进完善、评估整改效果，并经过前述四步骤的不断重复来形成良性的螺旋上升的优化路径，持续提升操作流程的标准化程度，增强内控机制的有效性。

报告期内，本基金运作合法合规，基金管理人各项业务运作正常，内部控制和风险防范措施不断完善并积极发挥作用。我们将持续提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金份额持有人的利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会相关规定和基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

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

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

4.8 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。

4.9 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情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 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	安永华明（2026）审字第70621126_B23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	圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金的财务报表，包括2025年12月31日的资产负债表，2025年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

	<p>我们认为，后附的圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金2025年12月31日的财务状况以及2025年度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《中国注册会计师独立性准则第1号--财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。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	无。
其他事项	无。
其他信息	<p>圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务

	<p>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，管理层负责评估圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资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，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>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）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出</p>

	<p>结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资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圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、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	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	施翊洲	徐晓岚
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层	
审计报告日期	2026-03-27	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：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	上年度末 2024年12月31日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	176,904.34	6,297.50

结算备付金		451,071.82	967,440.52
存出保证金		45,354.47	47,975.88
交易性金融资产	7.4.7.2	107,728,747.13	139,533,860.63
其中：股票投资		102,073,833.60	131,750,648.06
基金投资		-	-
债券投资		5,654,913.53	7,783,212.57
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	-192.33	-
应收清算款		1,435,220.36	429,480.66
应收股利		-	-
应收申购款		1,008.80	395.26
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		109,838,114.59	140,985,450.45
负债和净资产	附注号	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		230,000.00	839,919.21
应付清算款		-	-
应付赎回款		1,694,310.70	885,110.09
应付管理人报酬		92,125.91	142,368.66
应付托管费		9,212.60	14,236.88
应付销售服务费		509.89	8,595.76
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	7.4.7.6	204,781.98	242,494.59
负债合计		2,230,941.08	2,132,725.19
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	106,193,584.41	173,164,740.70
未分配利润	7.4.7.8	1,413,589.10	-34,312,015.44
净资产合计		107,607,173.51	138,852,725.26
负债和净资产总计		109,838,114.59	140,985,450.45

注：报告截止日2025年12月31日，基金份额总额106,193,584.41份，其中圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金A类基金份额净值1.0136元，圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金A类基金份额104,104,593.33份；圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金C类基金份额净值1.0011元，圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金C类基金份额2,088,991.08份。

7.2 利润表

会计主体：圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2025年01月01日至2025年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025年01月01日至 2025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至 2024年12月31日
一、营业总收入		29,258,247.85	3,978,343.77
1.利息收入		18,374.56	66,987.02
其中：存款利息收入	7.4.7.9	17,920.49	66,612.60
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		454.07	374.42
其他利息收入		-	-

2.投资收益（损失以“-”填列）		23,056,361.17	6,424,719.18
其中：股票投资收益	7.4.7.10	21,235,036.58	5,086,172.36
基金投资收益	7.4.7.11	-	-
债券投资收益	7.4.7.12	106,796.76	80,555.17
资产支持证券投资 收益	7.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	1,714,527.83	1,257,991.65
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	5,960,318.95	-2,997,783.31
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	223,193.17	484,420.88
减：二、营业总支出		1,357,998.38	978,550.45
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	1,078,350.07	739,054.90
2.托管费	7.4.10.2.2	107,834.99	73,905.45
3.销售服务费	7.4.10.2.3	20,314.68	19,969.18
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		13,498.64	7,620.92
其中：卖出回购金融资产支出		13,498.64	7,620.92
6.信用减值损失	7.4.7.19	-	-
7.税金及附加		-	-
8.其他费用	7.4.7.20	138,000.00	138,000.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		27,900,249.47	2,999,793.32
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		27,900,249.47	2,999,793.32
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		27,900,249.47	2,999,793.32

7.3 净资产变动表

会计主体：圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2025年01月01日至2025年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01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	173,164,740.70	-34,312,015.44	138,852,725.26
二、本期期初净资产	173,164,740.70	-34,312,015.44	138,852,725.26
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-66,971,156.29	35,725,604.54	-31,245,551.75
（一）、综合收益总额	-	27,900,249.47	27,900,249.47
（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）	-66,971,156.29	7,825,355.07	-59,145,801.22
其中：1.基金申购款	66,683,780.43	-16,090,799.85	50,592,980.58
2.基金赎回款	-133,654,936.72	23,916,154.92	-109,738,781.80
（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	106,193,584.41	1,413,589.10	107,607,173.51
项目	上年度可比期间 2024年01月01日至2024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	92,364,330.34	-21,433,934.41	70,930,395.93
二、本期期初净资产	92,364,330.34	-21,433,934.41	70,930,395.93
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	80,800,410.36	-12,878,081.03	67,922,329.33
（一）、综合收益总额	-	2,999,793.32	2,999,793.32
（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）	80,800,410.36	-15,877,874.35	64,922,536.01
其中：1.基金申购款	215,550,994.70	-41,420,691.68	174,130,303.02
2.基金赎回款	-134,750,584.34	25,542,817.33	-109,207,767.01
（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	173,164,740.70	-34,312,015.44	138,852,725.26

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：

高健

姚德明

刘雪峰

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]第3074号《关于准予圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》注册,由圆信永丰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币145,480,426.34元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第1112号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于2021年12月1日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为145,517,204.96份基金份额,其中认购资金利息折合36,778.62份基金份额。本基金的基金管理人为圆信永丰基金管理有限公司,基金托管人为国泰君安证券股份有限公司。根据《圆信永丰基金管理有限公司关于圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金基金托管人信息变更并修改基金合同等法律文件的公告》,自2025年4月3日起,国泰君安证券股份有限公司名称变更为“国泰海通证券股份有限公司”。

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

根据《圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金基金合同》和《圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》的规定,本基金根据所收取认购费、申购费、销售服务费用收取方式等差异,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购基金时收取认购/申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,并不再从该类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额。在投资人认购/申购基金时不收取认购/申购费,而是从该类别基金资产中计提销售服务费,在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额,称为C类基金份额。本基金A类基金份额和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算并公告基金份额净值和基金份额累计净值,基金份额净值计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股。此外,本基金的投资范围还可包括国内依法发行上市的非标的指数成份股票(包含主板、

创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、港股通标的股票、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债的纯债部分及其他中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可以根据有关法律法规规定进行融资及转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例不低于80%,其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的20%;投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金的业绩比较基准为:中证500指数收益率 \times 95%+同期银行活期存款利率(税后) \times 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人圆信永丰基金管理有限公司于2026年3月27日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《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、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”)编制,同时,在信息披露和估值方面,也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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年度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年度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。

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(例如它们都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基金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基金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债金融估值中心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《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号

《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

根据财政部、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》，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。

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

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

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

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	上年度末 2024年12月31日
活期存款	176,904.34	6,297.50
等于：本金	176,735.58	5,923.71
加：应计利息	168.76	373.79
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限1个月以内	-	-
存款期限1-3个月	-	-
存款期限3个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-

合计	176,904.34	6,297.50
----	------------	----------

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		99,940,386.33	-	102,073,833.60	2,133,447.27
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	5,600,548.67	53,273.53	5,654,913.53	1,091.33
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	5,600,548.67	53,273.53	5,654,913.53	1,091.33
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		105,540,935.00	53,273.53	107,728,747.13	2,134,538.60
项目		上年度末 2024年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		135,584,064.34	-	131,750,648.06	-3,833,416.28
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	7,707,794.07	67,782.57	7,783,212.57	7,635.93
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	7,707,794.07	67,782.57	7,783,212.57	7,635.93
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		143,291,858.41	67,782.57	139,533,860.63	-3,825,780.35

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

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

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-192.33	-
银行间市场	-	-
合计	-192.33	-
项目	上年度末 2024年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

注：截至本报告期末，本基金无未到期交易所债券逆回购，买入返售金融资产余额系因逆回购交收于清算的时间性差异而产生的利息。

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	上年度末 2024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	66,781.98	104,494.59
其中：交易所市场	66,781.98	104,494.59
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	138,000.00	138,000.00
合计	204,781.98	242,494.59

7.4.7.7 实收基金

7.4.7.7.1 圆信永丰中证500指数增强发起A

金额单位：人民币元

项目 (圆信永丰中证500指数增强发起A)	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	146,951,201.31	146,951,201.31
本期申购	66,590,498.90	66,590,498.90
本期赎回（以“-”号填列）	-109,437,106.88	-109,437,106.88
本期末	104,104,593.33	104,104,593.33

7.4.7.7.2 圆信永丰中证500指数增强发起C

金额单位：人民币元

项目 (圆信永丰中证500指数增强发起C)	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	26,213,539.39	26,213,539.39
本期申购	93,281.53	93,281.53
本期赎回（以“-”号填列）	-24,217,829.84	-24,217,829.84
本期末	2,088,991.08	2,088,991.08

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

7.4.7.8.1 圆信永丰中证500指数增强发起A

单位：人民币元

项目 (圆信永丰中证500指数增强发起A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-24,365,229.19	-4,588,315.07	-28,953,544.26
本期期初	-24,365,229.19	-4,588,315.07	-28,953,544.26
本期利润	21,528,336.40	5,359,133.80	26,887,470.20
本期基金份额交易产生的变动数	6,878,583.71	-3,401,295.97	3,477,287.74
其中：基金申购款	-11,295,076.18	-4,790,209.99	-16,085,286.17
基金赎回款	18,173,659.89	1,388,914.02	19,562,573.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,041,690.92	-2,630,477.24	1,411,213.68

7.4.7.8.2 圆信永丰中证500指数增强发起C

单位：人民币元

项目 (圆信永丰中证500指数增强发起C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-4,545,592.61	-812,878.57	-5,358,471.18
本期期初	-4,545,592.61	-812,878.57	-5,358,471.18
本期利润	411,594.12	601,185.15	1,012,779.27
本期基金份额交易产生的变动数	4,188,803.72	159,263.61	4,348,067.33
其中：基金申购款	-3,725.35	-1,788.33	-5,513.68
基金赎回款	4,192,529.07	161,051.94	4,353,581.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	54,805.23	-52,429.81	2,375.42

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2025年01月01日至2025年 12月31日	2024年01月01日至2024年 12月31日
活期存款利息收入	14,100.02	56,484.81
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	2,191.47	6,344.26
其他	1,629.00	3,783.53
合计	17,920.49	66,612.60

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01月01日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年 12月31日
卖出股票成交总额	789,366,268.78	577,258,249.36
减：卖出股票成本总额	767,341,330.41	571,482,464.93
减：交易费用	789,901.79	689,612.07
买卖股票差价收入	21,235,036.58	5,086,172.36

7.4.7.11 基金投资收益

无。

7.4.7.12 债券投资收益

7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年 12月31日
债券投资收益——利息收入	80,349.00	80,059.36
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差价收入	26,447.76	495.81

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	106,796.76	80,555.17

7.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月 31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	11,449,259.01	10,010,822.40
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	11,277,470.40	9,830,367.93
减：应计利息总额	145,336.74	179,957.62
减：交易费用	4.11	1.04
买卖债券差价收入	26,447.76	495.81

7.4.7.13 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

无。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2025年01月01日至2025年12月31日	2024年01月01日至2024年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,714,527.83	1,257,991.65
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	1,714,527.83	1,257,991.65

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日
1.交易性金融资产	5,960,318.95	-2,997,783.31
——股票投资	5,966,863.55	-3,005,419.24
——债券投资	-6,544.60	7,635.93
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	5,960,318.95	-2,997,783.31

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日

基金赎回费收入	185,172.88	484,420.88
转换费收入	38,020.29	-
合计	223,193.17	484,420.88

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

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

7.4.7.19 信用减值损失

无。

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年 12月31日
审计费用	18,000.00	18,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
合计	138,000.00	138,000.00

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

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
圆信永丰基金管理有限公司（“圆信永丰基金公司”）	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
国泰海通证券股份有限公司（“国泰海通证券”）	基金托管人、基金销售机构
厦门国际信托有限公司	基金管理人的股东

永丰证券投资信托股份有限公司	基金管理人的股东
----------------	----------

注1：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

注2：根据国泰海通证券股份有限公司发布的公告，自2025年4月3日起，国泰君安证券股份有限公司名称变更为“国泰海通证券股份有限公司”。根据《圆信永丰基金管理有限公司关于圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金基金托管人信息变更并修改基金合同等法律文件的公告》对本基金的基金合同、托管协议的相关条款进行修订。

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年01月01日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰海通证券	1,520,154,715.18	100.00%	1,216,662,646.05	100.00%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年01月01日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国泰海通证券	14,374,157.42	100.00%	16,868,650.09	100.00%

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年01月01日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日	
	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例
国泰海通 证券	190,960,000.00	100.00%	83,990,000.00	100.00%

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年01月01日至2025年12月31日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
国泰海通 证券	297,132.11	100.00%	66,781.98	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
国泰海通 证券	322,633.30	100.00%	104,494.59	100.00%

注1：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定。

注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，基

金管理人管理的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；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。相关佣金协议已根据此规定完成了更新。

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01月01日至20 25年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至20 24年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,078,350.07	739,054.90
其中：应支付销售机构的客户维护费	256,985.45	296,396.46
应支付基金管理人的净管理费	821,364.62	442,658.44

注：支付基金管理人圆信永丰基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 1.00%/ 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025 年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	107,834.99	73,905.45

注：支付基金托管人国泰海通证券的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的	本期 2025年01月01日至2025年12月31日

各关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	圆信永丰中证500指数增强发起A	圆信永丰中证500指数增强发起C	合计
国泰海通证券	0.00	2,263.91	2,263.91
圆信永丰基金公司	0.00	5,765.90	5,765.90
合计	0.00	8,029.81	8,029.81
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	圆信永丰中证500指数增强发起A	圆信永丰中证500指数增强发起C	合计
国泰海通证券	0.00	5,932.54	5,932.54
圆信永丰基金公司	0.00	3,863.77	3,863.77
合计	0.00	9,796.31	9,796.31

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给圆信永丰基金公司，再由圆信永丰基金公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费=前一日C类基金份额的基金资产净值 × 0.30%/ 当年天数。

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固有资金投资本基金的情况

圆信永丰中证500指数增强发起A

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2025年01月01日至 2025年12月31日	2024年01月01日至 2024年12月31日
报告期初持有的基金份额	-	10,001,666.83
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	10,001,666.83
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

注1：期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

注2：基金管理人圆信永丰基金公司在上年度可比期间内申购/赎回本基金的交易委托圆信永丰直销柜台办理。

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		上年度可比期间	
	2025年01月01日至2025年12月31日		2024年01月01日至2024年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
国泰海通 证券-活期 存款	176,904.34	14,100.02	6,297.50	56,484.81

注：本基金的活期银行存款账户由本基金托管人国泰海通证券开立在兴业银行股份有限公司，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2025年01月01日至2025年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额
国泰海通证券	113696	伯25转债	公开募集	10	1,000.00
上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额
国泰海通证券	-	-	-	-	-

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--固定净值型货币市场基金之外的基金

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

无。

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

截至本报告期末2025年12月31日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额230,000.00元，于2026年1月5日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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

本基金为股票型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金为股票型指数增强基金，具有与标的指数相似的风险收益特征，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制，力争获取高于标的指数的投资收益。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股。此外，为更好地实现投资目标，本基金的投资范围还可包括国内依法发行上市的非标的指数成份股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债的纯债部分及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金的基金管理人实行全面风险管理与全员风险管理。基金管理人以各岗位目标责任制为基础的第一道内控防线，员工在自律的前提下，相互监督制衡。各岗位职责明确，有详细的岗位说明书和业务流程，各岗位人员在授权范围内承担责任；以相关部门、相关岗位之间相互监督制衡的第二道内控防线，公司在相关部门和相关岗位之间建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，后续部门及岗位对前部门及岗位负有监督责任；以公司督察长、监察稽核部门对各岗位、各部门、各机构、各项业务全面实施监督反馈的第三道防线，督察长、监察稽核部门独立于其他部门，对内部控制制度的执行情况实行严格的检查和反馈；以董事会下属风险与合规管理委员会对公司经营管理和基金运作中的合法合规性实行全面监督的第四道防线。风险与合规管理委员会对公司经营和

基金运作中的风险进行严格的合规检查和风险控制评估并审议公司风险管理工作报告。董事会对基金管理人的风险管理负有最终责任。

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

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约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人开立于兴业银行股份有限公司的托管账户，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于2025年12月31日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券(2024年12月31日：同)。

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。

于本期末，除卖出回购金融资产款将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

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期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上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注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15%。于本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例未超过15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于本期末，本基金最近工作日确认的净赎回金额未超过组合资产中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。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金和债券投资等。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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025年1 2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	176,904.34	-	-	-	176,904.34
结算备付金	451,071.82	-	-	-	451,071.82
存出保证金	45,354.47	-	-	-	45,354.47
交易性金融资产	5,654,913.53	-	-	102,073,833.60	107,728,747.13
买入返售金融资产	-192.33	-	-	-	-192.33
应收清算款	-	-	-	1,435,220.36	1,435,220.36
应收申购款	-	-	-	1,008.80	1,008.80
资产总	6,328,051.83	-	-	103,510,062.76	109,838,114.59

计					
负债					
卖出回购金融资产款	230,000.00	-	-	-	230,000.00
应付赎回款	-	-	-	1,694,310.70	1,694,310.70
应付管理人报酬	-	-	-	92,125.91	92,125.91
应付托管费	-	-	-	9,212.60	9,212.60
应付销售服务费	-	-	-	509.89	509.89
其他负债	-	-	-	204,781.98	204,781.98
负债总计	230,000.00	-	-	2,000,941.08	2,230,941.08
利率敏感度缺口	6,098,051.83	-	-	101,509,121.68	107,607,173.51
上年度末 2024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	6,297.50	-	-	-	6,297.50
结算备付金	967,440.52	-	-	-	967,440.52
存出保证金	47,975.88	-	-	-	47,975.88
交易性金融资产	7,783,212.57	-	-	131,750,648.06	139,533,860.63

应收清算款	-	-	-	429,480.66	429,480.66
应收申购款	-	-	-	395.26	395.26
资产总计	8,804,926.47	-	-	132,180,523.98	140,985,450.45
负债					
卖出回购金融资产款	839,919.21	-	-	-	839,919.21
应付赎回款	-	-	-	885,110.09	885,110.09
应付管理人报酬	-	-	-	142,368.66	142,368.66
应付托管费	-	-	-	14,236.88	14,236.88
应付销售服务费	-	-	-	8,595.76	8,595.76
其他负债	-	-	-	242,494.59	242,494.59
负债总计	839,919.21	-	-	1,292,805.98	2,132,725.19
利率敏感度缺口	7,965,007.26	-	-	130,887,718.00	138,852,725.26

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5.26%(2024年12月31日：5.61%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2024年12月31日：同)。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。基金的投资组合比例为：本基金所持有的股票资产占基金资产的比例不低于80%，其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的20%；投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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		上年度末 2024年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	102,073,833.60	94.86	131,750,648.06	94.89
交易性金融资	-	-	-	-

产—基金投资				
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	102,073,833.60	94.86	131,750,648.06	94.89

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证500指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
	1.中证500指数上升5%	5,592,207.58	7,580,113.80
	2.中证500指数下降5%	-5,592,207.58	-7,580,113.80

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	上年度末 2024年12月31日

第一层次	102,073,833.60	131,750,648.06
第二层次	5,654,913.53	7,783,212.57
第三层次	-	-
合计	107,728,747.13	139,533,860.63

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、债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

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,907.64	1,907.64
转出第三层次	-	3,302.44	3,302.44
当期利得或损失总额	-	1,394.80	1,394.80
其中：计入损益的利得或损失	-	1,394.80	1,394.80
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层	-	-	-

项目	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益			
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况
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(2024年12月31日：同)。

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

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	102,073,833.60	92.93
	其中：股票	102,073,833.60	92.93
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,654,913.53	5.15
	其中：债券	5,654,913.53	5.15
	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	-192.33	0.00
	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	627,976.16	0.57
8	其他各项资产	1,481,583.63	1.35
9	合计	109,838,114.59	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	85,215.00	0.08
B	采矿业	4,710,368.00	4.38

C	制造业	55,852,089.60	51.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,434,066.00	4.12
E	建筑业	602,853.00	0.56
F	批发和零售业	2,817,434.00	2.62
G	交通运输、仓储和邮政业	2,437,088.00	2.26
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,717,926.00	6.24
J	金融业	8,169,559.00	7.59
K	房地产业	1,031,087.00	0.96
L	租赁和商务服务业	95,580.00	0.09
M	科学研究和技术服务业	457,089.00	0.42
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,155,540.00	1.07
S	综合	-	-
	合计	88,565,894.60	82.30

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	330,211.00	0.31
B	采矿业	140,105.00	0.13
C	制造业	10,431,337.00	9.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	51,408.00	0.05
E	建筑业	136,896.00	0.13

F	批发和零售业	221,270.00	0.21
G	交通运输、仓储和邮政业	287,182.00	0.27
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	615,300.00	0.57
J	金融业	256,410.00	0.24
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	548,226.00	0.51
N	水利、环境和公共设施管理业	489,594.00	0.45
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	13,507,939.00	12.55

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	002202	金风科技	55,600	1,134,240.00	1.05
2	600549	厦门钨业	24,900	1,022,394.00	0.95
3	688002	睿创微纳	9,900	997,920.00	0.93
4	301308	江波龙	3,800	930,392.00	0.86
5	002436	兴森科技	43,300	916,661.00	0.85
6	002558	巨人网络	19,700	852,813.00	0.79

7	300454	深信服	7,400	852,184.00	0.79
8	300450	先导智能	16,700	834,666.00	0.78
9	002414	高德红外	56,400	827,388.00	0.77
10	601717	中创智领	33,100	812,605.00	0.76
11	600988	赤峰黄金	25,300	790,372.00	0.73
12	300972	万辰集团	3,900	784,173.00	0.73
13	601168	西部矿业	27,600	762,864.00	0.71
14	688183	生益电子	7,900	755,951.00	0.70
15	002156	通富微电	19,700	742,690.00	0.69
16	600096	云天化	22,000	735,020.00	0.68
17	600392	盛和资源	33,800	727,714.00	0.68
18	002340	格林美	86,400	722,304.00	0.67
19	600801	华新建材	29,400	721,476.00	0.67
20	600378	昊华科技	22,500	719,100.00	0.67
21	600143	金发科技	36,400	711,256.00	0.66
22	600109	国金证券	71,600	665,880.00	0.62
23	600282	南钢股份	126,300	664,338.00	0.62
24	601991	大唐发电	187,800	655,422.00	0.61
25	002402	和而泰	16,500	645,480.00	0.60
26	603444	吉比特	1,500	635,775.00	0.59
27	002273	水晶光电	25,000	628,000.00	0.58
28	300207	欣旺达	24,000	627,600.00	0.58
29	600004	白云机场	66,000	624,360.00	0.58
30	301200	大族数控	5,200	617,604.00	0.57
31	002281	光迅科技	8,800	615,560.00	0.57
32	002850	科达利	3,800	599,868.00	0.56
33	688017	绿的谐波	3,100	595,510.00	0.55
34	688235	百济神州	2,186	587,159.60	0.55
35	600098	广州发展	89,500	585,330.00	0.54
36	603659	璞泰来	21,000	574,140.00	0.53
37	300857	协创数据	3,400	573,512.00	0.53

38	600995	南网储能	45,500	571,935.00	0.53
39	000933	神火股份	20,700	568,629.00	0.53
40	600885	宏发股份	18,700	568,480.00	0.53
41	000021	深科技	22,300	563,744.00	0.52
42	600699	均胜电子	17,900	561,344.00	0.52
43	000960	锡业股份	20,100	560,388.00	0.52
44	002185	华天科技	51,000	559,470.00	0.52
45	603233	大参林	31,400	553,268.00	0.51
46	300054	鼎龙股份	14,700	552,720.00	0.51
47	000783	长江证券	67,500	550,125.00	0.51
48	603979	金诚信	7,200	548,280.00	0.51
49	601233	桐昆股份	31,700	545,557.00	0.51
50	300017	网宿科技	52,200	535,050.00	0.50
51	002797	第一创业	77,700	533,799.00	0.50
52	300496	中科创达	7,900	533,250.00	0.50
53	300073	当升科技	9,200	531,760.00	0.49
54	002138	顺络电子	14,900	529,397.00	0.49
55	300458	全志科技	12,500	525,375.00	0.49
56	002294	信立泰	10,600	525,230.00	0.49
57	300373	扬杰科技	7,600	516,800.00	0.48
58	601128	常熟银行	72,800	512,512.00	0.48
59	603160	汇顶科技	6,400	505,600.00	0.47
60	002128	电投能源	18,100	505,171.00	0.47
61	688220	翱捷科技	6,100	503,921.00	0.47
62	002624	完美世界	30,700	503,173.00	0.47
63	688322	奥比中光	5,600	502,152.00	0.47
64	688702	盛科通信	3,500	495,915.00	0.46
65	000733	振华科技	9,400	492,654.00	0.46
66	600909	华安证券	70,900	480,702.00	0.45
67	300003	乐普医疗	30,200	477,462.00	0.44
68	603486	科沃斯	5,900	476,012.00	0.44

69	000887	中鼎股份	20,300	471,163.00	0.44
70	000893	亚钾国际	9,600	460,512.00	0.43
71	000623	吉林敖东	23,200	453,096.00	0.42
72	002841	视源股份	11,400	451,782.00	0.42
73	600369	西南证券	100,400	449,792.00	0.42
74	000009	中国宝安	45,600	449,160.00	0.42
75	002739	万达电影	39,600	448,272.00	0.42
76	600348	华阳股份	54,200	447,692.00	0.42
77	688213	思特威	4,700	446,923.00	0.42
78	603379	三美股份	7,300	443,256.00	0.41
79	600499	科达制造	31,800	441,066.00	0.41
80	601216	君正集团	91,500	441,030.00	0.41
81	000703	恒逸石化	40,800	439,416.00	0.41
82	601990	南京证券	55,000	435,600.00	0.40
83	603816	顾家家居	14,000	430,360.00	0.40
84	002078	太阳纸业	27,300	429,975.00	0.40
85	000932	华菱钢铁	75,900	426,558.00	0.40
86	688772	珠海冠宇	19,600	421,988.00	0.39
87	688166	博瑞医药	8,600	421,916.00	0.39
88	000729	燕京啤酒	37,400	420,002.00	0.39
89	600166	福田汽车	143,700	419,604.00	0.39
90	600704	物产中大	74,500	414,965.00	0.39
91	002603	以岭药业	24,100	411,387.00	0.38
92	600884	杉杉股份	30,000	405,300.00	0.38
93	600977	中国电影	25,700	404,004.00	0.38
94	600998	九州通	78,600	402,432.00	0.37
95	002410	广联达	31,900	401,302.00	0.37
96	600685	中船防务	14,100	401,145.00	0.37
97	600863	内蒙华电	89,500	400,960.00	0.37
98	600380	健康元	34,600	399,630.00	0.37
99	002244	滨江集团	39,500	396,975.00	0.37

100	300735	光弘科技	15,900	395,274.00	0.37
101	601880	辽港股份	246,900	395,040.00	0.37
102	600848	上海临港	33,700	394,290.00	0.37
103	300012	华测检测	28,900	391,595.00	0.36
104	688295	中复神鹰	11,900	390,439.00	0.36
105	000997	新大陆	13,700	387,984.00	0.36
106	301358	湖南裕能	6,000	387,960.00	0.36
107	600970	中材国际	36,700	381,313.00	0.35
108	002821	凯莱英	4,100	381,013.00	0.35
109	002773	康弘药业	12,700	380,619.00	0.35
110	000598	兴蓉环境	53,000	380,010.00	0.35
111	002673	西部证券	47,800	377,142.00	0.35
112	600517	国网英大	62,600	376,226.00	0.35
113	002152	广电运通	27,000	372,870.00	0.35
114	000513	丽珠集团	10,800	372,168.00	0.35
115	600873	梅花生物	36,300	367,719.00	0.34
116	000883	湖北能源	80,100	363,654.00	0.34
117	600739	辽宁成大	32,400	362,232.00	0.34
118	001696	宗申动力	16,700	362,223.00	0.34
119	000750	国海证券	85,300	361,672.00	0.34
120	002085	万丰奥威	22,500	360,225.00	0.33
121	000738	航发控制	16,900	360,139.00	0.33
122	600642	申能股份	46,100	358,658.00	0.33
123	688778	厦钨新能	4,600	355,902.00	0.33
124	600578	京能电力	69,400	353,940.00	0.33
125	600497	驰宏锌锗	48,300	353,073.00	0.33
125	000050	深天马A	39,100	353,073.00	0.33
126	000959	首钢股份	71,800	351,820.00	0.33
127	600038	中直股份	9,700	350,461.00	0.33
128	600295	鄂尔多斯	28,100	347,316.00	0.32
129	601997	贵阳银行	58,700	344,569.00	0.32

130	601958	金钼股份	22,100	344,318.00	0.32
131	600862	中航高科	14,500	342,635.00	0.32
132	603858	步长制药	21,900	342,516.00	0.32
133	002056	横店东磁	17,300	337,350.00	0.31
134	600967	内蒙一机	20,000	336,000.00	0.31
135	600562	国睿科技	11,800	333,468.00	0.31
136	600535	天士力	22,000	331,540.00	0.31
137	601108	财通证券	38,000	331,360.00	0.31
138	000987	越秀资本	40,700	331,298.00	0.31
139	002926	华西证券	35,500	329,440.00	0.31
140	688301	奕瑞科技	3,200	323,552.00	0.30
141	601228	广州港	99,800	323,352.00	0.30
142	601555	东吴证券	35,600	322,536.00	0.30
143	600583	海油工程	58,700	322,263.00	0.30
144	688561	奇安信	8,800	313,104.00	0.29
145	688728	格科微	20,700	309,258.00	0.29
146	603565	中谷物流	30,400	305,216.00	0.28
147	601019	山东出版	35,100	303,264.00	0.28
148	000062	深圳华强	12,200	300,364.00	0.28
149	002299	圣农发展	18,100	299,374.00	0.28
150	000657	中钨高新	10,700	296,497.00	0.28
151	300146	汤臣倍健	24,600	295,446.00	0.27
152	688578	艾力斯	2,800	291,620.00	0.27
153	000709	河钢股份	123,900	286,209.00	0.27
154	600959	江苏有线	82,700	284,488.00	0.26
155	600927	永安期货	17,700	284,439.00	0.26
156	300888	稳健医疗	7,500	283,800.00	0.26
157	600563	法拉电子	2,700	283,365.00	0.26
158	688019	安集科技	1,300	283,296.00	0.26
159	600483	福能股份	29,900	283,153.00	0.26
160	603699	纽威股份	5,400	280,638.00	0.26

161	601333	广深铁路	90,500	275,120.00	0.26
162	600131	国网信通	16,600	267,924.00	0.25
163	600095	湘财股份	23,400	258,804.00	0.24
164	300763	锦浪科技	3,600	257,076.00	0.24
165	601577	长沙银行	25,900	251,230.00	0.23
166	688819	天能股份	7,500	249,150.00	0.23
167	600007	中国国贸	12,100	239,822.00	0.22
168	003022	联泓新科	12,100	239,701.00	0.22
169	600546	山煤国际	23,200	234,088.00	0.22
170	002608	江苏国信	31,100	229,829.00	0.21
171	000937	冀中能源	42,700	229,726.00	0.21
172	600339	中油工程	67,200	225,120.00	0.21
173	601162	天风证券	54,100	225,056.00	0.21
174	600688	上海石化	79,800	221,844.00	0.21
175	600170	上海建工	83,600	221,540.00	0.21
176	600118	中国卫星	2,300	218,385.00	0.20
177	002008	大族激光	5,300	218,307.00	0.20
178	601000	唐山港	54,700	210,048.00	0.20
179	300136	信维通信	3,100	192,200.00	0.18
180	000898	鞍钢股份	74,400	188,232.00	0.17
181	600580	卧龙电驱	3,800	186,580.00	0.17
182	600352	浙江龙盛	17,000	181,220.00	0.17
183	600062	华润双鹤	9,500	173,755.00	0.16
184	600487	亨通光电	6,800	168,164.00	0.16
185	600879	航天电子	7,100	151,372.00	0.14
186	002595	豪迈科技	1,700	143,667.00	0.13
187	002472	双环传动	3,000	142,230.00	0.13
188	000582	北部湾港	15,000	140,700.00	0.13
189	603129	春风动力	500	139,340.00	0.13
190	688525	佰维存储	1,200	137,748.00	0.13
191	600157	永泰能源	87,300	137,061.00	0.13

192	002738	中矿资源	1,700	133,535.00	0.12
193	600126	杭钢股份	15,200	124,032.00	0.12
194	300474	景嘉微	1,700	122,179.00	0.11
195	600141	兴发集团	3,500	121,030.00	0.11
196	600298	安琪酵母	2,700	118,098.00	0.11
197	600536	中国软件	2,500	115,750.00	0.11
198	603087	甘李药业	1,700	115,719.00	0.11
199	002444	巨星科技	3,400	115,668.00	0.11
200	002064	华峰化学	10,400	114,400.00	0.11
201	600021	上海电力	5,700	114,114.00	0.11
202	603766	隆鑫通用	6,900	111,159.00	0.10
203	002318	久立特材	3,800	110,010.00	0.10
204	300567	精测电子	1,200	109,440.00	0.10
205	002080	中材科技	3,000	109,020.00	0.10
206	002223	鱼跃医疗	2,800	106,988.00	0.10
207	600435	北方导航	6,700	103,314.00	0.10
208	300604	长川科技	1,000	101,310.00	0.09
209	000060	中金岭南	17,200	100,620.00	0.09
210	600177	雅戈尔	13,100	99,560.00	0.09
211	000415	渤海租赁	23,600	95,580.00	0.09
212	002966	苏州银行	11,500	95,335.00	0.09
213	603077	和邦生物	41,000	92,660.00	0.09
214	688180	君实生物	2,700	92,232.00	0.09
215	601608	中信重工	13,900	91,601.00	0.09
216	600901	江苏金租	14,900	91,188.00	0.08
217	600132	重庆啤酒	1,700	88,808.00	0.08
218	002312	川发龙蟒	8,000	87,440.00	0.08
219	600598	北大荒	5,700	85,215.00	0.08
220	600808	马钢股份	20,100	84,822.00	0.08
221	000629	钒钛股份	26,900	83,390.00	0.08
222	601866	中远海发	32,700	82,404.00	0.08

223	601918	新集能源	12,300	81,303.00	0.08
224	601001	晋控煤业	6,100	80,215.00	0.07
225	600968	海油发展	19,900	76,416.00	0.07
226	601665	齐鲁银行	12,600	72,324.00	0.07
227	603345	安井食品	900	71,352.00	0.07
228	003035	南网能源	14,300	65,494.00	0.06
229	601699	潞安环能	5,300	62,540.00	0.06
230	002195	岩山科技	7,700	54,593.00	0.05
231	001213	中铁特货	12,400	50,220.00	0.05
232	600079	ST人福	2,200	39,842.00	0.04
233	002958	青农商行	12,700	39,370.00	0.04
234	002203	海亮股份	3,100	39,246.00	0.04
235	300699	光威复材	900	35,514.00	0.03
236	600332	白云山	1,200	30,888.00	0.03
237	000429	粤高速A	2,600	30,628.00	0.03
238	002517	恺英网络	1,200	26,244.00	0.02
239	000423	东阿阿胶	500	24,540.00	0.02
240	603737	三棵树	500	23,135.00	0.02
241	603298	杭叉集团	700	18,599.00	0.02
242	002532	天山铝业	1,000	16,180.00	0.02
243	603156	养元饮品	400	11,500.00	0.01
244	603927	中科软	600	11,454.00	0.01

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	300970	华绿生物	16,100	330,211.00	0.31
2	688577	浙海德曼	3,100	300,266.00	0.28
3	300614	百川畅银	22,800	289,104.00	0.27

4	002486	嘉麟杰	89,600	278,656.00	0.26
5	688329	艾隆科技	12,800	272,512.00	0.25
6	688256	寒武纪	200	271,110.00	0.25
7	300949	奥雅股份	6,900	270,480.00	0.25
8	603880	南卫股份	43,300	269,759.00	0.25
9	000100	TCL科技	59,000	267,860.00	0.25
10	688498	源杰科技	400	256,796.00	0.24
11	002048	宁波华翔	7,900	248,534.00	0.23
12	301273	瑞晨环保	9,200	243,708.00	0.23
13	002921	联诚精密	14,300	243,386.00	0.23
14	301192	泰祥股份	8,100	240,489.00	0.22
15	001259	利仁科技	7,600	228,076.00	0.21
16	605033	美邦股份	11,300	226,904.00	0.21
17	301072	中捷精工	10,000	225,200.00	0.21
18	002545	东方铁塔	12,200	225,090.00	0.21
19	601872	招商轮船	24,800	222,704.00	0.21
20	688528	秦川物联	20,600	221,862.00	0.21
21	600082	海泰发展	54,500	221,270.00	0.21
22	300823	建科智能	14,100	220,242.00	0.20
23	688565	力源科技	19,600	219,324.00	0.20
24	688521	芯原股份	1,600	219,152.00	0.20
25	300112	万讯自控	25,400	218,694.00	0.20
26	301314	科瑞思	5,200	218,504.00	0.20
27	300243	瑞丰高材	20,800	216,944.00	0.20
28	688021	奥福科技	11,800	216,530.00	0.20
29	688132	邦彦技术	11,700	215,514.00	0.20
30	300219	鸿利智汇	29,800	214,858.00	0.20
31	300930	屹通新材	7,200	213,840.00	0.20
32	688313	仕佳光子	2,400	213,072.00	0.20
33	002055	ST得润	31,600	212,984.00	0.20
34	301360	荣旗科技	3,000	212,700.00	0.20

35	688429	时创能源	16,200	212,058.00	0.20
36	002719	麦趣尔	24,800	211,792.00	0.20
37	300257	开山股份	14,800	207,940.00	0.19
38	688659	元琛科技	21,300	201,285.00	0.19
39	688701	卓锦股份	24,600	200,490.00	0.19
40	300615	欣天科技	15,000	199,200.00	0.19
41	300246	宝莱特	23,800	192,780.00	0.18
42	002193	如意集团	35,800	190,456.00	0.18
43	688496	清越科技	31,900	189,486.00	0.18
44	003030	祖名股份	9,300	187,767.00	0.17
45	688331	荣昌生物	2,400	186,696.00	0.17
46	300649	杭州园林	12,400	178,064.00	0.17
47	301198	喜悦智行	12,400	155,744.00	0.14
48	300535	达威股份	8,400	150,024.00	0.14
49	002963	豪尔赛	9,200	136,896.00	0.13
50	688419	耐科装备	4,700	131,553.00	0.12
51	600188	兖矿能源	6,700	88,105.00	0.08
52	688237	超卓航科	1,800	87,750.00	0.08
53	300502	新易盛	200	86,176.00	0.08
54	300750	宁德时代	200	73,452.00	0.07
55	688127	蓝特光学	1,800	69,282.00	0.06
56	688108	赛诺医疗	3,600	69,264.00	0.06
57	300274	阳光电源	400	68,416.00	0.06
58	603799	华友钴业	1,000	68,260.00	0.06
59	300743	天地数码	3,000	66,960.00	0.06
60	601100	恒立液压	600	65,946.00	0.06
61	000301	东方盛虹	6,000	65,340.00	0.06
62	920207	众诚科技	2,900	64,960.00	0.06
63	603259	药明康德	700	63,448.00	0.06
64	000333	美的集团	800	62,520.00	0.06
65	002475	立讯精密	1,100	62,381.00	0.06

66	601138	工业富联	1,000	62,050.00	0.06
67	002222	福晶科技	1,100	61,974.00	0.06
68	000792	盐湖股份	2,200	61,952.00	0.06
69	601318	中国平安	900	61,560.00	0.06
70	601328	交通银行	8,400	60,900.00	0.06
71	688038	中科通达	3,400	60,078.00	0.06
72	300032	金龙机电	11,000	59,070.00	0.05
73	002600	领益智造	3,800	59,052.00	0.05
74	300438	鹏辉能源	1,100	58,542.00	0.05
75	300162	雷曼光电	7,200	58,536.00	0.05
76	601988	中国银行	10,200	58,446.00	0.05
77	002518	科士达	1,200	58,224.00	0.05
78	920152	昆工科技	2,600	57,720.00	0.05
79	600115	中国东航	9,600	57,600.00	0.05
80	688426	康为世纪	2,400	57,192.00	0.05
81	603993	洛阳钼业	2,600	52,000.00	0.05
82	600795	国电电力	10,200	51,408.00	0.05
83	300066	三川智慧	7,800	48,594.00	0.05
84	600887	伊利股份	1,500	42,900.00	0.04
85	002839	张家港行	9,200	42,044.00	0.04
86	000708	中信特钢	2,300	37,651.00	0.03
87	688509	正元地信	6,600	36,234.00	0.03
88	000768	中航西飞	1,400	35,532.00	0.03
89	002625	光启技术	700	34,132.00	0.03
90	601319	中国人保	3,100	27,745.00	0.03
91	002849	威星智能	1,300	20,670.00	0.02
92	300417	南华仪器	600	8,394.00	0.01
93	600221	海航控股	3,800	6,878.00	0.01
94	601009	南京银行	500	5,715.00	0.01
95	301037	保立佳	300	4,320.00	0.00

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	300476	胜宏科技	4,464,281.00	3.22
2	300803	指南针	4,009,176.00	2.89
3	600549	厦门钨业	3,639,192.00	2.62
4	002156	通富微电	3,584,526.14	2.58
5	600096	云天化	3,468,014.00	2.50
6	002185	华天科技	3,404,669.00	2.45
7	600392	盛和资源	3,197,321.00	2.30
8	000021	深科技	3,143,834.00	2.26
9	603893	瑞芯微	3,116,089.00	2.24
10	600885	宏发股份	3,107,323.20	2.24
11	601717	中创智领	3,106,823.00	2.24
12	002202	金风科技	3,097,722.00	2.23
13	000623	吉林敖东	3,068,947.00	2.21
14	002273	水晶光电	3,057,774.00	2.20
15	600909	华安证券	3,013,656.00	2.17
16	600699	均胜电子	2,982,432.00	2.15
17	600998	九州通	2,923,272.00	2.11
18	300373	扬杰科技	2,899,586.00	2.09
19	600801	华新建材	2,881,196.00	2.08
20	600380	健康元	2,863,720.00	2.06
21	300763	锦浪科技	2,831,036.00	2.04
22	002410	广联达	2,825,236.00	2.03
23	601168	西部矿业	2,800,319.00	2.02

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

8.4.2 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	300476	胜宏科技	6,549,153.00	4.72
2	300803	指南针	4,816,384.55	3.47
3	000623	吉林敖东	4,086,469.00	2.94
4	688538	和辉光电	3,910,179.37	2.82
5	600392	盛和资源	3,860,123.00	2.78
6	600352	浙江龙盛	3,822,006.00	2.75
7	600885	宏发股份	3,821,423.40	2.75
8	603893	瑞芯微	3,725,092.00	2.68
9	000060	中金岭南	3,707,310.00	2.67
10	002340	格林美	3,696,090.00	2.66
11	600096	云天化	3,689,186.00	2.66
12	002625	光启技术	3,684,630.00	2.65
13	601568	北元集团	3,560,799.00	2.56
14	000021	深科技	3,548,957.00	2.56
15	002185	华天科技	3,455,721.00	2.49
16	600549	厦门钨业	3,386,004.00	2.44
17	600663	陆家嘴	3,382,597.00	2.44
18	600299	安迪苏	3,352,946.00	2.41
19	601717	中创智领	3,337,059.00	2.40
20	002202	金风科技	3,336,481.00	2.40
21	000050	深天马A	3,309,042.00	2.38
22	688180	君实生物	3,261,892.69	2.35
23	300136	信维通信	3,156,626.00	2.27
24	688122	西部超导	3,146,878.74	2.27
25	300919	中伟新材	3,133,041.40	2.26

26	600699	均胜电子	3,119,945.00	2.25
27	601958	金钼股份	3,059,061.00	2.20
28	600499	科达制造	3,042,744.00	2.19
29	002156	通富微电	3,041,510.00	2.19
30	600582	天地科技	3,012,580.00	2.17
31	300373	扬杰科技	3,004,072.00	2.16
32	000728	国元证券	3,003,507.00	2.16
33	600879	航天电子	2,989,794.00	2.15
34	601598	中国外运	2,982,536.00	2.15
35	600380	健康元	2,979,891.00	2.15
36	600528	中铁工业	2,976,141.00	2.14
37	600517	国网英大	2,909,306.00	2.10
38	000783	长江证券	2,899,156.00	2.09
39	300763	锦浪科技	2,840,279.00	2.05
40	300604	长川科技	2,838,961.00	2.04

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

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	731,697,652.40
卖出股票收入（成交）总额	789,366,268.78

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

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	5,654,913.53	5.26
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-

	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,654,913.53	5.26

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	019773	25国债08	52,000	5,252,501.48	4.88
2	019785	25国债13	4,000	402,412.05	0.37

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

根据基金合同约定，本基金不参与贵金属投资。

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

根据基金合同约定，本基金不参与权证投资。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

8.12 投资组合报告附注

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

通过查阅中国证监会、国家金融监督管理总局网站公开目录“行政处罚决定”及查阅相关发行主体的公司公告，在基金管理人知悉的范围内，报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的情形，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 本基金前十名股票未超出基金合同规定备选股票库。

8.12.3 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	45,354.47
2	应收清算款	1,435,220.36
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,008.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,481,583.63

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限的情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中未存在流通受限的情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§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
圆信永丰中证500指数增强发起A	718	144,992.47	66,005,290.85	63.40%	38,099,302.48	36.60%
圆信永丰中证500指数增强发起C	11	189,908.28	0.00	0.00%	2,088,991.08	100.00%
合计	729	145,670.21	66,005,290.85	62.16%	40,188,293.56	37.84%

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	圆信永丰中证500指数增强发起A	428,659.30	0.41%
	圆信永丰中证500指数增强发起C	-	-
	合计	428,659.30	0.40%

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	圆信永丰中证500指数增强发起A	0
	圆信永丰中证500指数增强发起C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	圆信永丰中证500指数增强发起A	10~50
	圆信永丰中证500指数增强发起C	0
	合计	10~50

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

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

注：本基金为发起式基金，基金合同生效日为2021年12月1日，截至本报告期末，基金管理公司固有资金持有发起份额的持有期限已满三年。截止本报告期末，基金管理公司持有的本基金份额占基金总份额比例为0%。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	圆信永丰中证500指数 增强发起A	圆信永丰中证500指数 增强发起C
基金合同生效日(2021年12月01日)基金份额总额	135,514,663.33	10,002,541.63
本报告期期初基金份额总额	146,951,201.31	26,213,539.39
本报告期基金总申购份额	66,590,498.90	93,281.53
减：本报告期基金总赎回份额	109,437,106.88	24,217,829.84
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	104,104,593.33	2,088,991.08

§11 重大事件揭示**11.1 基金份额持有人大会决议**

报告期内，未召开基金份额持有人大会且无决议。

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

报告期内，基金管理人的重大人事变动：2025年3月27日，兰文伟先生离任公司督察长；同日，由公司总经理高健女士代为履行公司督察长职责。2025年9月26日，王几高先生担任公司督察长，公司总经理高健女士不再代为履行公司督察长职责。

报告期内，托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。本报告期内应支付审计费用18,000.00元，该审计机构已提供审计服务的持续年限为2年。

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

本基金本报告期内管理人未存在受调查或处罚的情况。

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本基金本报告期内管理人相关从业人员未存在受调查或处罚的情况。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本基金本报告期内托管人未存在受调查或处罚的情况。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本基金本报告期内托管人相关从业人员未存在受调查或处罚的情况。

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	
国泰海通	3	1,520,154,715.18	100.00%	297,132.11	100.00%	-

注1：本报告期内基金无新增证券公司交易单元。

注2：本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。

选择租用证券公司基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 资金实力雄厚，财务状况良好；
- (2) 经营行为稳健规范，在业内有良好的声誉；
- (3) 内控制度健全，内部管理严格，具有良好的合规风控能力，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要，并能为基金管理提供全面的信息服务；
- (5) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员；
- (6) 具有较强的全方位金融研究、服务能力和水平。

注3：基金选择证券公司交易单元的选择程序如下：

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

(2) 本基金管理人与被选中的证券公司签订交易单元租用协议。

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
国泰海通	14,374,157.42	100.00%	190,960,000.00	100.00%	-	-	-	-

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	圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金2024年第四季度报告	证监会规定媒介	2025-01-22
2	圆信永丰基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金申购、转换转入金额限制的公告	证监会规定媒介	2025-03-01
3	圆信永丰基金管理有限公司关于提醒投资者警惕不法分子冒用“圆信永丰基金”名义从事诈骗活动的风险提示公告	证监会规定媒介	2025-03-06
4	圆信永丰基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金申购、转换转入金额限制的公告	证监会规定媒介	2025-03-12
5	圆信永丰基金管理有限公司	证监会规定媒介	2025-03-28

	基金行业高级管理人员变更公告		
6	圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金2024年年度报告	证监会规定媒介	2025-03-31
7	圆信永丰基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司交易及佣金支付情况公告	证监会规定媒介	2025-03-31
8	关于圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金基金托管人信息变更并修改基金合同等法律文件的公告	证监会规定媒介	2025-04-04
9	圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金托管协议更新	证监会规定媒介	2025-04-04
10	圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金基金合同更新	证监会规定媒介	2025-04-04
11	圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金招募说明书更新	证监会规定媒介	2025-04-09
12	圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新	证监会规定媒介	2025-04-09
13	圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金2025年第一季度报告	证监会规定媒介	2025-04-22
14	圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新	证监会规定媒介	2025-06-27
15	圆信永丰基金管理有限公司关于圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金	证监会规定媒介	2025-07-04

	关联交易事项的公告		
16	圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金2025年第二季度报告	证监会规定媒介	2025-07-21
17	圆信永丰基金管理有限公司关于提醒投资者警惕不法分子冒用"圆信永丰基金"名义从事诈骗活动的风险提示公告	证监会规定媒介	2025-08-08
18	圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金2025年中期报告	证监会规定媒介	2025-08-30
19	圆信永丰基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证监会规定媒介	2025-09-27
20	圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金2025年第三季度报告	证监会规定媒介	2025-10-28
21	圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金招募说明书更新	证监会规定媒介	2025-12-31

§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

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
机构	1	20250417-20251231	-	66,005,280.53	-	66,005,280.53	62.16%
	2	20250101-20250507	36,917,302.49	-	36,917,302.49	-	0.00%
	3	20250101-20250212	36,917,302.49	-	36,917,302.49	-	0.00%
产品特有风险							

本基金报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情形。如该单一投资者大额赎回将可能导致基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。

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、中国证监会批准圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金设立的文件；
- 2、《圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、报告期内在规定报刊上披露的各项公告；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

13.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人圆信永丰基金管理有限公司。

咨询电话：4006070088

公司网址：<http://www.gtsfund.com.cn>

圆信永丰基金管理有限公司

二〇二六年三月三十一日