

财通中证 A500 指数增强型证券投资基金 2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人:财通基金管理有限公司

基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司

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、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2026年3月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自2025年06月26日（基金合同生效日）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	7
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	13
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	14
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	15
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	16
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	16
§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	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	22
7.3 净资产变动表	23
7.4 报表附注	24
§8 投资组合报告	52
8.1 期末基金资产组合情况	52
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	52
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	54

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	67
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	76
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.....	77
§9 基金份额持有人信息.....	78
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
§10 开放式基金份额变动.....	79
§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.....	80
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.....	83
§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.....	84
§13 备查文件目录.....	84
13.1 备查文件目录.....	84
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	财通中证A500指数增强型证券投资基金	
基金简称	财通中证A500指数增强	
场内简称	-	
基金主代码	024337	
交易代码	-	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025年06月26日	
基金管理人	财通基金管理有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	28,341,944.76份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	财通中证A500指数增强A	财通中证A500指数增强C
下属分级基金场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	024337	024338
报告期末下属分级基金的份额总额	16,040,219.68份	12,301,725.08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，在对标的指数进行有效跟踪的基础上，结合增强型的主动投资，进行积极的组合管理和风险控制，力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金的主要投资策略包括：股票（含存托凭证）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、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略。
业绩比较基准	中证A500指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%

<p>风险收益特征</p>	<p>本基金是股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，跟踪中证A500指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。本基金可以投资港股通标的股票，将承担汇率风险以及因投资环境、投资标的、市场制度、交易规则差异等带来的境外市场的风险。</p>	
<p>下属分级基金的风险收益特征</p>	<p>本基金是股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，跟踪中证A500指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。本基金可以投资港股通标的股票，将承担汇率风险以及因投资环境、投资标的、市场制度、交易规则差异等带来的境外市场的风险。</p>	<p>本基金是股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，跟踪中证A500指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。本基金可以投资港股通标的股票，将承担汇率风险以及因投资环境、投资标的、市场制度、交易规则差异等带来的境外市场的风险。</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		财通基金管理有限公司	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	方斌	张立学
	联系电话	021-20537888	010-68858113
	电子邮箱	service@ctfund.com	zhanglixue@psbcoa.com.cn
客户服务电话		400-820-9888	95580

传真	021-68888169/021-68888661	010-86353609
注册地址	上海市虹口区吴淞路619号505室	北京市西城区金融大街3号
办公地址	上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心43、45楼	北京市西城区金融大街3号A座
邮政编码	200120	100808
法定代表人	吴林惠	郑国雨

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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ctfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东长安街1号东方广场毕马威大楼八层
注册登记机构	财通基金管理有限公司	上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心43、45楼

§3 主要财务指标、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	本期2025年06月26日（基金合同生效日） - 2025年12月31日	
	财通中证A500指数增强A	财通中证A500指数增强C
本期已实现收益	7,207,589.80	4,549,833.91

本期利润	8,238,731.70	3,645,183.99
加权平均基金份额本期利润	0.0928	0.0648
本期加权平均净值利润率	9.07%	6.32%
本期基金份额净值增长率	11.35%	11.12%
3.1.2 期末数据和指标	2025年末	
期末可供分配利润	1,821,248.50	1,368,411.28
期末可供分配基金份额利润	0.1135	0.1112
期末基金资产净值	17,861,468.18	13,670,136.36
期末基金份额净值	1.1135	1.1112
3.1.3 累计期末指标	2025年末	
基金份额累计净值增长率	11.35%	11.12%

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

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

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

(4)本基金基金合同于本报告期内生效，故无比较式的上年度数据。

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

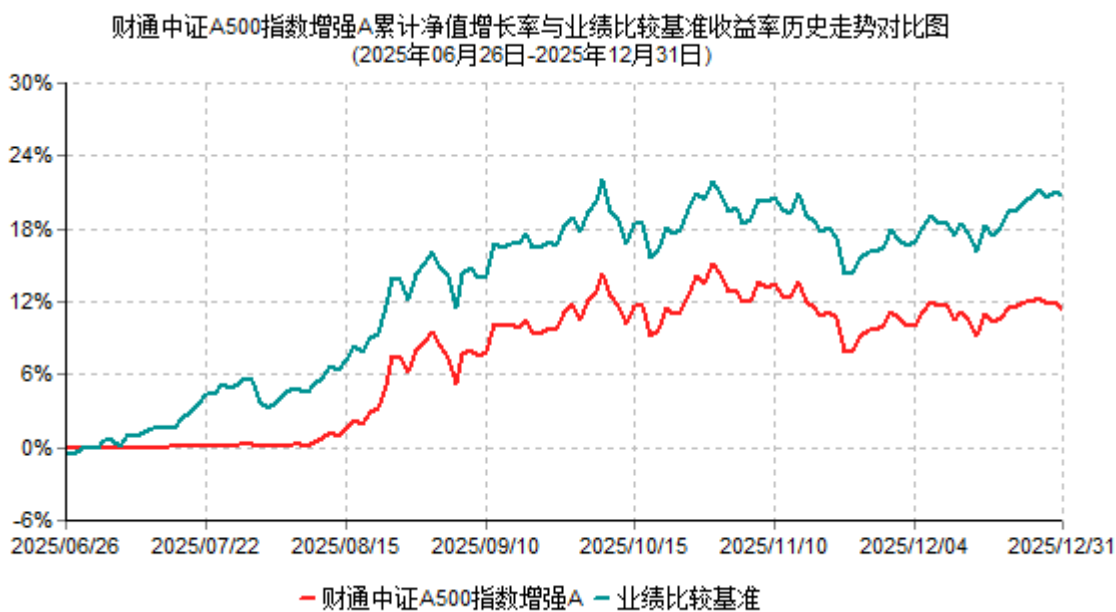
财通中证A500指数增强A

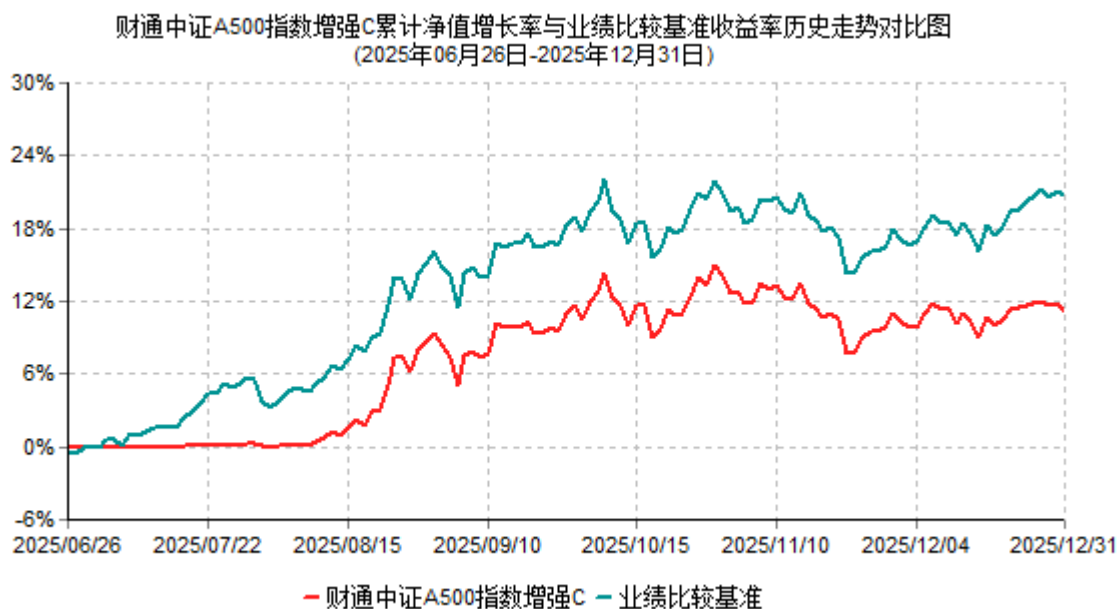
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.37%	0.94%	0.43%	1.00%	-1.80%	-0.06%
过去六个月	11.35%	0.86%	20.71%	0.95%	-9.36%	-0.09%
自基金合同生效起至今	11.35%	0.85%	20.69%	0.94%	-9.34%	-0.09%

财通中证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	-1.47%	0.94%	0.43%	1.00%	-1.90%	-0.06%
过去六个月	11.13%	0.86%	20.71%	0.95%	-9.58%	-0.09%
自基金合同生效起至今	11.12%	0.85%	20.69%	0.94%	-9.57%	-0.09%

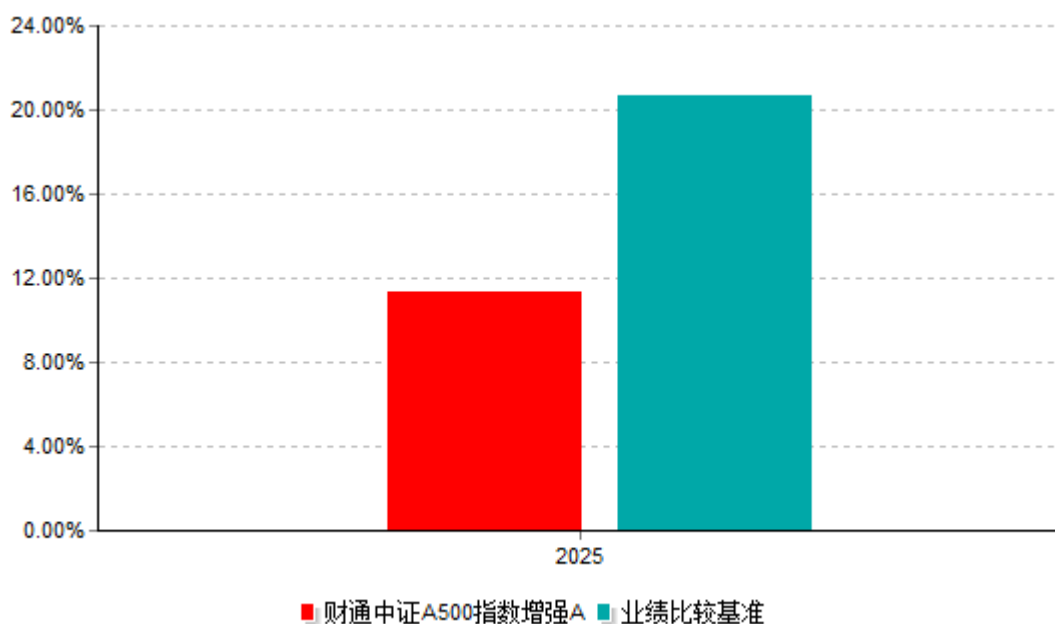
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

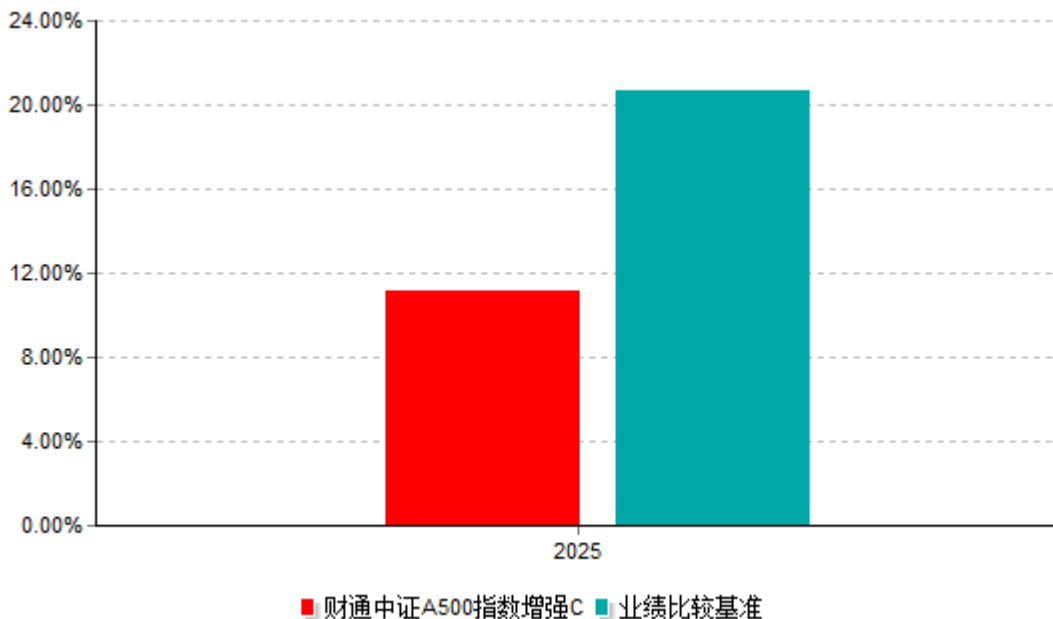




注：(1)本基金合同生效日为2025年06月26日，基金合同生效起至本报告期末不满一年；
(2)本基金建仓期为自基金合同生效起6个月内，建仓期结束时，本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

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2025年06月26日，合同生效当年按实际存续期计算相关数据，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

本基金的《基金合同》生效日为2025年6月26日，截至2025年12月31日，本基金未进行过利润分配。

§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

财通基金管理有限公司（下称“财通基金”）经中国证监会批准，于2011年6月正式成立。目前公司拥有公募基金管理、特定客户资产管理、QDII、受托管理保险资金投资管理等业务资格。公司股东为财通证券股份有限公司、杭州市实业投资集团有限公司和浙江亨通控股股份有限公司，注册资本2亿元人民币，注册地上海。成立14年来，公司收获了“三大报”权威奖项（金牛奖+金基金奖+明星基金奖），先后荣获164项业内权威大奖。

截至2025年12月末，财通基金合计管理规模约1,253.16亿元，其中，公募基金管理规模约849.03亿元。公司以打造“特色鲜明、多元发展、客户信赖”的一流资产管理公司为企业愿景，坚持多元化业务布局，旗下公募基金覆盖股票、混合、债券、指数、货币等完整产品线，可满足不同类型客户的多元化需求。同时公司在专户业务中勇于突破，不断探索定增+、固收+、量化+等特色领域，努力以专业创造价值。

财通基金始终恪守“敬畏、感恩、专业、责任”的核心价值观，坚信投研是核心竞争力，为客户创造收益才是硬道理。公司以资产管理为本源，坚守初心、苦练内功，配备了一支资深投研专家团队，纵深一级半、二级市场，持续为投资者创造价值。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
顾弘原	本基金的基金经理	2025-06-26	-	9年	伦敦政治经济学院统计学硕士。历任香港伟享证券有限公司分析师。2017年2月加入财通基金管理有限公司，曾任量化投资部助理研究员、研究员，现任量化投资部基金经理。

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

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

(3)证券从业的含义遵从法律法规及行业协会的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.1.4 基金经理薪酬机制

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规以及公司内部管理制度，制定了《财通基金管理有限公司公平交易管理办法》，规范包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时包括授权、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各个环节，以保证公司旗下管理的不同投资组合之间不存在利益输送并得到公平对待，以及保护投资者合法权益。

在投资决策环节：（1）内部建立信息公开、资源共享的公平投资管理环境，不存在个别组合获得信息落后或不全面的情况；（2）建立健全公司适用的投资对象备选库和交易对手备选库，制定明确的备选库建立、维护程序；（3）执行健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分；（4）建立投资组合投资信息的管理及保密制度，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息应相互隔离。

在交易执行环节：（1）集中交易部与投资、研究部门严格实行物理隔离，以充分保障集中交易部的独立性与保密性，同时建立和完善公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；（2）投资交易系统支持公平交易功能，不同投资组合同向买卖同一证券的交易分配原则为“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”；（3）严格控制同一投资组合或不同投资组合之间在同一交易日内进行反向交易；（4）所有投资对象的交易指令必须经由集中交易部负责人或其授权人审核分配至交易员执行，进行投资指令分配的人员必须保证投资指令得到公平对待，应保证不同投资组合在同一时点就同一投资对象下达的相同方向的投资指令分配给同一交易员完成；（5）对于交易所公开竞价交易，公司在投资交易系统设置强制公平交易模式，系统遇到该类两个或两个以上不同投资组合发出同向买卖指令情形时，会自动提示交易员进入公平交易模式；（6）对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理应在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量。公司在获配额度确定后，严格按照价格优先的原则在各投资组合间进行分配，申购价格相同的投资组合则根据投资指令的数量按比例进行分配。

在行为监控和分析报告环节：（1）风险管理部对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控，保证分配结果符合公平交易原则的要求；（2）风险管理部应根据市场公认的第三方信息，对投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查。相关投资组合经理应对交易价格异常情况进行合理性解释；（3）风险管理部对不同投资组合，尤其是同一位投资组合经

理管理的不同投资组合同日同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行监控和分析，相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释。

在交易价差分析和信息披露环节：（1）风险管理部负责交易价差分析；（2）风险管理部应分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的收益率差异，对连续四个季度期间的不同时间窗内公司管理的不同投资组合进行同向交易的交易价差分析，形成公平交易报告并由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存以备查；（3）在各投资组合的定期报告中，至少应披露以下事项：公司整体公平交易制度执行情况、对异常交易行为做专项说明。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，本基金按照既定的投资策略和量化模型进行投资，采用类行业中性配置，力争控制行业暴露在较低范围之内，同时控制组合相对市场主流风格如大小盘、价值、成长等的暴露，采用量化模型在行业内优选个股，分散持仓，力争追求相对业绩基准的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，财通中证A500指数增强A基金份额净值为1.1135元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为11.35%，同期业绩比较基准收益率为20.69%；截至本报告期末，财通中证A500指数增强C基金份额净值为1.1112元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为11.12%，同期业绩比较基准收益率为20.69%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

站在2025年底来看，外部宏观风险整体减弱，“反内卷”政策效果持续显现，我国经济整体维持在稳步向好的趋势中。不过整体上，经济动能有所转弱，一方面2024年四季

度基数偏高，另一方面，2025年上半年面对外部冲击时，财政节奏前置，导致下半年脉冲偏弱。不过12月份PMI表现超季节性，彰显出当下经济较为强韧，与此同时CPI和PPI的趋势回升表明“反内卷”导向下供需结构或不断均衡，为私人部门盈利改善提供了良好的基础。

海外方面，以美国为代表的经济体基本面表现在2025年依旧稳健。12月联储议息会议“鹰派”降息落地，后续海外货币政策取决于后续就业、通胀数据表现而进行相机抉择。整体上，海外延续了政策不确定性下降，经济平稳运行的态势。

展望2026年资本市场，我们预计A股ROE有望再度抬升。一方面，“反内卷”导向下，上游大宗价格已经出现起势，2026年PPI或将缓慢抬升，从而使得传统工业企业利润出现改善。另一方面，全球PMI共振向上叠加以AI算力链为代表的新兴产业持续迭代，引领资本开支提速，使得上游设备类企业受益。整体来看，权益市场有望迎来戴维斯双击，目前部分行业盈利端企稳改善已经初见端倪，在此格局下，市场上行趋势具备良好基础。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人依照国家相关法律法规和公司内部管理制度全面深入推进监察稽核各项工作。公司法律合规部在权限范围内，对公司各部门执行公司内控制度及各项规章制度情况进行监察，对公司各项业务活动的合法性、合规性、合理性进行监督稽核、评价、报告和建议。通过各项合规管理措施以及实时监控、定期检查、专项检查等方法，对基金的投资运作、基金销售、基金运营、客户服务、信息披露等进行了重点监控与稽核，发现问题及时提出改进建议，并督促相关部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。公司重视对员工的合规培训，开展了多次培训活动，加强对员工行为的管理，增强员工合规意识。公司还通过网站、邮件等多种形式进行了投资者教育工作。

本报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规，有效保障了基金份额持有人利益。本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，建立健全风险管理体系，进一步提高监察稽核工作的科学性和有效性，最大限度地防范和化解经营风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会负责根据相关估值原则研究相关估值政策和估值模型，拟定公司的估值政策、估值方法和估值程序，确定调整/暂停估值方案，确保公司各基金产品净值计算的公允性，以维护广大投资者的利益。估值委员会配备投资、研究、会计、风控等岗位资深人员，成员具有会计核算经

验、行业分析经验、金融工具应用、风险管理等丰富的证券投资基金行业从业经验和专业能力。基金经理如果认为某证券有更能准确反应其公允价值的估值方法，可以向估值委员会申请对其进行专项评估。估值方法/价格调整需经估值委员会决议通过，并征询基金托管人同意后才能采纳。

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配。

本报告期内本基金未进行过利润分配。

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

本报告期内，本基金未有连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人的情形；基金资产净值于2025年10月30日至2025年12月31日连续45个工作日低于5000万元。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在财通中证A500指数增强型证券投资基金（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认真地复核，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。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、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	毕马威华振审字第2603540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	财通中证A500指数增强型证券投资基金
审计意见	<p>我们审计了后附的财通中证A500指数增强型证券投资基金(以下简称“该基金”)财务报表,包括2025年12月31日的资产负债表,自2025年06月26日(基金合同生效日)至2025年12月31日止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)及财务报表附注7.4.2中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制,公允反映了该基金2025年12月31日的财务状况以及自2025年06月26日(基金合同生效日)至2025年12月31日止期间的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则(以下简称“审计准则”)的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则和《中国注册会计师独立性准则第1号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》中适用于公众利益实体财务报表审计业务的独立性要求,我们独立于该基金,并履行了</p>

	<p>职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	<p>该基金管理人财通基金管理有限公司（以下简称“该基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金2025年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	<p>该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注7.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该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，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。</p> <p>该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于</p>

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。

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：

(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。

(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。

(3)评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4)对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对该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该基金不能持续经营。

(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。 我们与该基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	黄小熠	侯雯
会计师事务所的地址	北京市东长安街1号东方广场毕马威大楼八层	
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：财通中证A500指数增强型证券投资基金

报告截止日：2025年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025年12月31日
资产：		
货币资金	7.4.7.1	5,140,451.07
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	28,924,570.82
其中：股票投资		28,924,570.82
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	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收清算款		-

应收股利		-
应收申购款		1,565.40
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.5	-
资产总计		34,066,587.29
负债和净资产	附注号	本期末 2025年12月31日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		2,413,609.25
应付管理人报酬		26,480.17
应付托管费		4,965.01
应付销售服务费		5,895.22
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	84,033.10
负债合计		2,534,982.75
净资产：		
实收基金	7.4.7.7	28,341,944.76
未分配利润	7.4.7.8	3,189,659.78
净资产合计		31,531,604.54
负债和净资产总计		34,066,587.29

注：(1)报告截止日2025年12月31日，基金份额总额28,341,944.76份。其中A类基金的份额净值1.1135元，份额总额16,040,219.68份；C类基金的份额净值1.1112元，份额总额12,301,725.08份。

(2)本基金基金合同于本报告期内生效，故无比较式的上年度数据。

7.2 利润表

会计主体：财通中证A500指数增强型证券投资基金

本报告期：2025年06月26日（基金合同生效日）至2025年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025年06月26日（基金合同 生效日）至2025年12月31 日
一、营业总收入		12,782,073.51
1.利息收入		542,522.70
其中：存款利息收入	7.4.7.9	91,801.48
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		450,721.22
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		12,098,689.13
其中：股票投资收益	7.4.7.10	11,662,059.33
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.11	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.12	-
股利收益	7.4.7.13	436,629.80
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	126,491.98
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	14,369.70
减：二、营业总支出		898,157.82
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	589,206.22

2.托管费	7.4.10.2.2	110,476.15
3.销售服务费	7.4.10.2.3	114,475.45
4.投资顾问费		-
5.利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.信用减值损失	7.4.7.16	-
7.税金及附加		-
8.其他费用	7.4.7.17	84,000.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		11,883,915.69
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		11,883,915.69
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		11,883,915.69

注：本基金基金合同于本报告期内生效，故无比较式的上年度数据。

7.3 净资产变动表

会计主体：财通中证A500指数增强型证券投资基金

本报告期：2025年06月26日（基金合同生效日）至2025年12月31日

单位：人民币元

项目	本期		
	2025年06月26日（基金合同生效日）至2025年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	413,151,809.20	-	413,151,809.20
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-384,809,864.44	3,189,659.78	-381,620,204.66
（一）、综合收益总额	-	11,883,915.69	11,883,915.69
（二）、本期基金	-384,809,864.44	-8,694,255.91	-393,504,120.35

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	26,763,635.06	2,462,462.58	29,226,097.64
2.基金赎回款	-411,573,499.50	-11,156,718.49	-422,730,217.99
（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	28,341,944.76	3,189,659.78	31,531,604.54

注：本基金基金合同于本报告期内生效，故无比较式的上年度数据。

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：

徐春庭

刘为臻

孙金

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

财通中证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]998号文《关于准予财通中证A500指数增强型证券投资基金注册的批复》准予注册,由基金管理人财通基金管理有限公司向社会公开发行募集,基金合同于2025年06月26日生效,本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币413,069,671.21元,募集资金在募集期间产生的利息为人民币82,137.99元,以上收到的实收基金(本息)共计人民币413,151,809.20元,折合基金份额413,151,809.20份,其中A类基金份额248,493,700.48份,C类基金份额164,658,108.72份。本基金的基金管理人及注册登记机构为财通基金管理有限公司,基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

本基金根据销售费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别,分别设置代码、分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。在投资者认购、申购时收取认购、

申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为A类基金份额；在投资人认购、申购时不收取认购、申购费用，而从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为C类基金份额。

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

基金的投资组合比例为：股票（含存托凭证）资产占基金资产的比例不低于80%（其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产（含存托凭证）的50%），其中投资于标的指数成份股和备选成份股占非现金基金资产的比例不低于80%。每个交易日日终，在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，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。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为：中证A500指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注7.4.2中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金2025年12月31日的财务状况、自2025年6月26日(基金合同生效日)至2025年12月31日止期间的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为自2025年6月26日(基金合同生效日)至2025年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，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资、债券投资、买入返售金融资产等。

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、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摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，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。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无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。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(b) 金融负债的分类

本基金将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及以摊余成本计量的金融负债。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债 (含属于金融负债的衍生工具) 和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

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

(a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b) 后续计量

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失 (包括利息和股利收入) 计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

- 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失 (包括利息费用) 计入当期损益。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 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；
- 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。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

(d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限（包括考虑续约选择权）。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来12个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后12个月内（若金融工具的预计存续期少于12个月，则为预计存续期）可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，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，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，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。采用估值技术确定公允价值时，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。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，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

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

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份额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。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入证券出借业务利息收入。

投资收益

股票投资收益、债券投资收益、资产支持证券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生工具、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

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逐日确认。

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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金份额持有人可对A类和C类基金份额选择不同的分红方式；同一投资人持有的同一类别的基金份额只能选择一种分红方式，如投资人在不同销售机构选择的分红方式不同，则基金份额登记机构将以投资人最后一次选择的分红方式为准；基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；本基金各基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。同一类别的每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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。

外币货币性项目，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汇兑损益科目。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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

对于证券交易所上市的股票，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》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[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》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号文《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[2016]127号文《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》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《关于全面

推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、中投信〔2021〕20号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部公告2019年第93号《关于继续执行沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财政部税务总局公告2023年第2号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部 税务总局 中国证监会公告2023年第23号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。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，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b)对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

对证券投资基金从中国内地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。

c)对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、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。内地个人投资者通过沪港通、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。对内地证券投资基金通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，按照上述规定计征个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至2027年12月31日。

d)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。对于基金通过沪港通、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。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日
活期存款	882,976.85
等于：本金	882,647.31
加：应计利息	329.54
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	4,257,474.22
等于：本金	4,257,420.95
加：应计利息	53.27
减：坏账准备	-
合计	5,140,451.07

注：其他存款期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

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	28,798,078.84	-	28,924,570.82	126,491.98
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	28,798,078.84	-	28,924,570.82	126,491.98

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 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。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,000.00
其他应付	33.10
合计	84,033.10

7.4.7.7 实收基金

7.4.7.7.1 财通中证A500指数增强A

金额单位：人民币元

项目 (财通中证A500指数增强A)	本期 2025年06月26日（基金合同生效日）至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	248,493,700.48	248,493,700.48
本期申购	13,101,322.88	13,101,322.88
本期赎回（以“-”号填列）	-245,554,803.68	-245,554,803.68
本期末	16,040,219.68	16,040,219.68

7.4.7.7.2 财通中证A500指数增强C

金额单位：人民币元

项目 (财通中证A500指数增强C)	本期 2025年06月26日（基金合同生效日）至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	164,658,108.72	164,658,108.72
本期申购	13,662,312.18	13,662,312.18
本期赎回（以“-”号填列）	-166,018,695.82	-166,018,695.82
本期末	12,301,725.08	12,301,725.08

注：(1)申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

(2)本基金基金合同生效日为2025年6月26日。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币413,069,671.21元，在募集期间产生的存款利息为人民币82,137.99元，以上实收基金（本息）合计为人民币413,151,809.20元，折合413,151,809.20份基金份额，其中A类基金份额248,493,700.48份，C类基金份额164,658,108.72份。

7.4.7.8 未分配利润

7.4.7.8.1 财通中证A500指数增强A

单位：人民币元

项目 (财通中证A500指数增强A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	7,207,589.80	1,031,141.90	8,238,731.70
本期基金份额交易产生的变动数	-4,236,111.49	-2,181,371.71	-6,417,483.20
其中：基金申购款	1,216,202.38	-69,050.62	1,147,151.76
基金赎回款	-5,452,313.87	-2,112,321.09	-7,564,634.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,971,478.31	-1,150,229.81	1,821,248.50

7.4.7.8.2 财通中证A500指数增强C

单位：人民币元

项目 (财通中证A500指数增强C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	4,549,833.91	-904,649.92	3,645,183.99
本期基金份额交易产生的变动数	-2,300,528.17	23,755.46	-2,276,772.71
其中：基金申购款	1,832,004.96	-516,694.14	1,315,310.82
基金赎回款	-4,132,533.13	540,449.60	-3,592,083.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,249,305.74	-880,894.46	1,368,411.28

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年06月26日（基金合同生效日）至2025年12月31日
活期存款利息收入	86,091.97
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	5,709.51
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	91,801.48

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年06月26日（基金合同生效日）至2025年12月31日
卖出股票成交总额	258,148,587.98

减：卖出股票成本总额	246,221,204.97
减：交易费用	265,323.68
买卖股票差价收入	11,662,059.33

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期未有债券投资收益。

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期未有买卖债券差价收入。

7.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期未有债券赎回差价收入。

7.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期未有债券申购差价收入。

7.4.7.12 衍生工具收益

7.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益--买卖权证差价收入。

7.4.7.12.2 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。

7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2025年06月26日（基金合同生效日）至2025年12月31日
股票投资产生的股利收益	436,629.80
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	436,629.80

7.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025年06月26日（基金合同生效日）至2025年12月31日
1.交易性金融资产	126,491.98
——股票投资	126,491.98
——债券投资	-
——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	126,491.98

7.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年06月26日（基金合同生效日）至2025年12月31日
基金赎回费收入	14,369.70
合计	14,369.70

7.4.7.16 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2025年06月26日（基金合同生效日）至2025年12月31日

审计费用	24,000.00
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	-
合计	84,000.00

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

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

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

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
财通基金管理有限公司（"财通基金"）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国邮政储蓄银行股份有限公司（"邮储银行"）	基金托管人、基金销售机构
财通证券股份有限公司（"财通证券"）	基金管理人的股东、基金代销机构
杭州市实业投资集团有限公司	基金管理人的股东
浙江亨通控股股份有限公司	基金管理人的股东
上海财通资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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06月26日（基金合同生效日）至2025年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例

财通证券	191,505,626.67	36.13%
------	----------------	--------

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

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06月26日（基金合同生效日）至2025年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
财通证券	1,910,000,000.00	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06月26日（基金合同生效日）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
财通证券	44,326.21	40.06%	-	-

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，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

(2)自2024年7月1日起，券商仅为本基金提供交易单元租用以及研究服务。

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06月26日（基金合同生效日）至2025年

	12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	589,206.22
其中：应支付销售机构的客户维护费	281,708.48
应支付基金管理人的净管理费	307,497.74

注：(1)支付基金管理人的基金管理费按前一日基金资产净值的0.80%年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付；

(2)基金管理费计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.80%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年06月26日（基金合同生效日）至2025年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	110,476.15

注：(1)支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付；

(2)基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2025年06月26日（基金合同生效日）至2025年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	财通中证A500指数增强A	财通中证A500指数增强C	合计
财通证券	0.00	108,697.62	108,697.62
邮储银行	0.00	915.53	915.53
合计	0.00	109,613.15	109,613.15

注：(1)本基金A类基金份额不收取销售服务费；

(2)本基金C类基金份额销售服务费按C类基金份额前一日基金资产净值的0.40%年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付；

(3)本基金C类基金份额销售服务费的计算公式为：每日应计提的销售服务费=C类基金份额前一日基金资产净值×0.40%/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

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

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

本基金管理人本报告期末未运用固有资金投资本基金。

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

除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未投资本基金。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年06月26日（基金合同生效日）至2025年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
邮储银行	882,976.85	86,091.97
财通证券	3,173,405.24	3,426.41

注：本基金用于证券交易结算的资金通过基金管理人的股东财通证券转存，按证券账户活期利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项的说明。

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

本基金本报告期无当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用。

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

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002049	紫光国微	2025-12-30	重大事項	78.81	2026-01-15	86.69	1,600	123,492.00	126,096.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

于2025年12月31日，本基金未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于2025年12月31日，本基金未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

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

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

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对各类投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估，建立相应的分级别的交易对手库，并分别限定交易额度，同时采取一定的风险缓释措施。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司，还有部分存款存放在开立于本基金的结算机构财通证券和中邮证券的证券账户内，按银行同业利率计息，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间

同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式、对手授信额度、价格偏离等方面进行限制以控制相应的信用风险。

7.4.13.3 流动性风险

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

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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

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

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

本基金本报告期末无重大流动性风险。

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现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利

率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年12 月31 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1 年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币 资金	5,140,451.0 7	-	-	-	-	-	5,140,451.07
交易 性金 融资 产	-	-	-	-	-	28,924,570.8 2	28,924,570.8 2
应收 申购 款	-	-	-	-	-	1,565.40	1,565.40
资产 总计	5,140,451.0 7	-	-	-	-	28,926,136.2 2	34,066,587.2 9
负债							
应付 赎回 款	-	-	-	-	-	2,413,609.25	2,413,609.25
应付 管理 人报 酬	-	-	-	-	-	26,480.17	26,480.17
应付	-	-	-	-	-	4,965.01	4,965.01

托管费							
应付销售服务费	-	-	-	-	-	5,895.22	5,895.22
其他负债	-	-	-	-	-	84,033.10	84,033.10
负债总计	-	-	-	-	-	2,534,982.75	2,534,982.75
利率敏感度缺口	5,140,451.07	-	-	-	-	26,391,153.47	31,531,604.54

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

截至报告期末，本基金无交易性债券投资，因此利率风险因素对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，以价值投资为核心，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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	28,924,570.82	91.73
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	28,924,570.82	91.73

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.基金的市场价格风险决定于基金相对其业绩比较基准的贝塔系数，以及业绩比较基准的变动。	
	2.除业绩比较基准变动外，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。	
	3.贝塔系数的估计以过去一年的历史数据作为样本，采用线性回归法估计。	
	4.业绩比较基准的变动对基金的净值表现具有对称性影响。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2025年12月31日
	业绩比较基准增加1%	270,567.31
	业绩比较基准减少1%	-270,567.31

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

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

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

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025年12月31日
第一层次	28,798,474.82
第二层次	126,096.00
第三层次	-
合计	28,924,570.82

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

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

本基金于本报告期末未持有任何公允价值所属层次为第三层次的金融工具。

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

本基金于本报告期末未持有任何公允价值所属层次为第三层次的金融工具。

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，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于2025年12月31日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§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	28,924,570.82	84.91
	其中：股票	28,924,570.82	84.91
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	5,140,451.07	15.09
8	其他各项资产	1,565.40	0.00
9	合计	34,066,587.29	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	46,458.00	0.15
B	采矿业	1,127,337.00	3.58
C	制造业	16,284,037.82	51.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	778,722.00	2.47
E	建筑业	200,178.00	0.63
F	批发和零售业	350,584.00	1.11
G	交通运输、仓储和邮政业	533,630.00	1.69
H	住宿和餐饮业	1,675.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,642,423.00	5.21
J	金融业	3,063,011.00	9.71
K	房地产业	58,253.00	0.18
L	租赁和商务服务业	63,334.00	0.20
M	科学研究和技术服务业	336,762.00	1.07
N	水利、环境和公共设施管理业	11,762.00	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	4,384.00	0.01
Q	卫生和社会工作	251,802.00	0.80
R	文化、体育和娱乐业	14,356.00	0.05
S	综合	-	-
	合计	24,768,708.82	78.55

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	-	-
B	采矿业	249,912.00	0.79

C	制造业	2,325,576.00	7.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	79,750.00	0.25
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	408,279.00	1.29
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	325,547.00	1.03
J	金融业	373,837.00	1.19
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	243,741.00	0.77
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	149,220.00	0.47
S	综合	-	-
	合计	4,155,862.00	13.18

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通机制投资的港股。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)

1	300750	宁德时代	3,000	1,101,780.00	3.49
2	600519	贵州茅台	600	826,308.00	2.62
3	300502	新易盛	1,800	775,584.00	2.46
4	300308	中际旭创	1,200	732,000.00	2.32
5	688256	寒武纪	500	677,775.00	2.15
6	000333	美的集团	7,400	578,310.00	1.83
7	300274	阳光电源	3,200	547,328.00	1.74
8	002594	比亚迪	5,600	547,232.00	1.74
9	688981	中芯国际	4,070	499,918.10	1.59
10	300476	胜宏科技	1,600	460,128.00	1.46
11	600030	中信证券	15,600	447,876.00	1.42
12	002475	立讯精密	7,800	442,338.00	1.40
13	000725	京东方A	96,300	405,423.00	1.29
14	600887	伊利股份	14,000	400,400.00	1.27
15	601398	工商银行	48,600	385,398.00	1.22
16	601318	中国平安	5,300	362,520.00	1.15
17	600150	中国船舶	10,617	353,121.42	1.12
18	000988	华工科技	4,400	349,052.00	1.11
19	000001	平安银行	29,800	340,018.00	1.08
20	300033	同花顺	1,000	322,180.00	1.02
21	002625	光启技术	6,600	321,816.00	1.02
22	002352	顺丰控股	8,300	318,056.00	1.01
23	002241	歌尔股份	11,000	316,030.00	1.00
24	600547	山东黄金	8,100	313,551.00	0.99
25	600549	厦门钨业	7,400	303,844.00	0.96
26	000768	中航西飞	11,600	294,408.00	0.93
27	002074	国轩高科	7,500	293,325.00	0.93
28	601728	中国电信	46,000	289,800.00	0.92
29	600584	长电科技	7,700	283,206.00	0.90
30	601766	中国中车	41,000	279,620.00	0.89
31	002156	通富微电	7,400	278,980.00	0.88

32	000100	TCL科技	61,300	278,302.00	0.88
33	000651	格力电器	6,900	277,518.00	0.88
34	600010	包钢股份	116,500	277,270.00	0.88
35	600011	华能国际	36,800	274,528.00	0.87
36	600332	白云山	10,600	272,844.00	0.87
37	002236	大华股份	14,300	270,842.00	0.86
38	000538	云南白药	4,600	261,096.00	0.83
39	688506	百利天恒	800	258,480.00	0.82
40	002155	湖南黄金	11,800	248,862.00	0.79
41	601727	上海电气	28,700	247,107.00	0.78
42	300015	爱尔眼科	22,500	247,050.00	0.78
43	601899	紫金矿业	7,000	241,290.00	0.77
44	000938	紫光股份	9,800	241,080.00	0.76
45	300759	康龙化成	8,100	230,283.00	0.73
46	002252	上海莱士	36,300	230,142.00	0.73
47	003816	中国广核	61,000	229,360.00	0.73
48	000858	五粮液	2,100	222,474.00	0.71
49	601601	中国太保	5,200	217,932.00	0.69
50	000034	神州数码	5,600	217,896.00	0.69
51	601328	交通银行	29,200	211,700.00	0.67
52	600036	招商银行	4,600	193,660.00	0.61
53	600941	中国移动	1,900	191,995.00	0.61
54	002230	科大讯飞	3,700	186,073.00	0.59
55	000009	中国宝安	18,000	177,300.00	0.56
56	601127	赛力斯	1,400	169,344.00	0.54
57	600196	复星医药	6,300	166,887.00	0.53
58	000338	潍柴动力	9,500	163,400.00	0.52
59	600839	四川长虹	16,000	145,600.00	0.46
60	000063	中兴通讯	3,600	136,224.00	0.43
61	600795	国电电力	26,400	133,056.00	0.42
62	002049	紫光国微	1,600	126,096.00	0.40

63	600276	恒瑞医药	1,700	101,269.00	0.32
64	603259	药明康德	1,100	99,704.00	0.32
65	601288	农业银行	12,400	95,232.00	0.30
66	600511	国药股份	3,300	94,875.00	0.30
67	002340	格林美	10,600	88,616.00	0.28
68	300059	东方财富	3,700	85,766.00	0.27
69	601216	君正集团	17,400	83,868.00	0.27
70	300088	长信科技	13,358	80,949.48	0.26
71	601166	兴业银行	3,600	75,816.00	0.24
72	601988	中国银行	13,000	74,490.00	0.24
73	300496	中科创达	1,100	74,250.00	0.24
74	600760	中航沈飞	1,300	72,995.00	0.23
75	600900	长江电力	2,600	70,694.00	0.22
76	601668	中国建筑	13,600	69,768.00	0.22
77	300124	汇川技术	900	67,797.00	0.22
78	600031	三一重工	2,800	59,164.00	0.19
79	600000	浦发银行	4,400	54,736.00	0.17
80	601816	京沪高铁	10,500	54,075.00	0.17
81	601390	中国中铁	9,000	48,690.00	0.15
82	601088	中国神华	1,200	48,600.00	0.15
83	000426	兴业银锡	1,300	46,280.00	0.15
84	002714	牧原股份	900	45,522.00	0.14
85	603019	中科曙光	500	42,820.00	0.14
86	603993	洛阳钼业	2,000	40,000.00	0.13
87	601857	中国石油	3,700	38,517.00	0.12
88	600309	万华化学	500	38,340.00	0.12
89	601012	隆基绿能	2,100	38,220.00	0.12
90	600089	特变电工	1,700	37,774.00	0.12
91	600111	北方稀土	800	36,896.00	0.12
92	600690	海尔智家	1,300	33,917.00	0.11
93	000792	盐湖股份	1,200	33,792.00	0.11

94	000425	徐工机械	2,900	33,582.00	0.11
95	002415	海康威视	1,100	32,824.00	0.10
96	600660	福耀玻璃	500	32,385.00	0.10
97	601919	中远海控	2,100	31,878.00	0.10
98	600050	中国联通	6,000	30,660.00	0.10
99	600028	中国石化	4,900	30,282.00	0.10
100	601600	中国铝业	2,400	29,328.00	0.09
101	002463	沪电股份	400	29,228.00	0.09
102	600406	国电南瑞	1,300	29,224.00	0.09
103	601225	陕西煤业	1,300	27,716.00	0.09
104	002050	三花智控	500	27,655.00	0.09
105	603799	华友钴业	400	27,304.00	0.09
106	601985	中国核电	2,900	25,085.00	0.08
107	600418	江淮汽车	500	24,750.00	0.08
108	600104	上汽集团	1,600	24,352.00	0.08
109	600938	中国海油	800	24,144.00	0.08
110	601006	大秦铁路	4,500	23,220.00	0.07
111	600905	三峡能源	5,300	21,677.00	0.07
112	603986	兆易创新	100	21,425.00	0.07
113	600489	中金黄金	900	21,024.00	0.07
114	000625	长安汽车	1,700	20,162.00	0.06
115	000963	华东医药	500	19,725.00	0.06
116	002709	天赐材料	400	18,532.00	0.06
117	603288	海天味业	500	18,510.00	0.06
118	600438	通威股份	900	18,468.00	0.06
119	600019	宝钢股份	2,400	17,880.00	0.06
120	600585	海螺水泥	800	17,488.00	0.06
121	002558	巨人网络	400	17,316.00	0.05
122	002384	东山精密	200	16,930.00	0.05
123	601669	中国电建	3,200	16,640.00	0.05
124	000807	云铝股份	500	16,420.00	0.05

125	002027	分众传媒	2,200	16,214.00	0.05
126	600085	同仁堂	500	16,130.00	0.05
127	600893	航发动力	400	16,012.00	0.05
128	600988	赤峰黄金	500	15,620.00	0.05
129	300433	蓝思科技	500	15,135.00	0.05
130	600115	中国东航	2,500	15,000.00	0.05
131	601360	三六零	1,300	14,521.00	0.05
132	600415	小商品城	900	14,355.00	0.05
133	002195	岩山科技	2,000	14,180.00	0.04
134	002179	中航光电	400	14,176.00	0.04
135	300058	蓝色光标	1,200	13,824.00	0.04
136	000157	中联重科	1,600	13,808.00	0.04
137	002407	多氟多	400	13,564.00	0.04
138	300014	亿纬锂能	200	13,152.00	0.04
139	600009	上海机场	400	13,104.00	0.04
140	600066	宇通客车	400	13,080.00	0.04
141	300207	欣旺达	500	13,075.00	0.04
142	000002	万科A	2,800	13,020.00	0.04
143	601058	赛轮轮胎	800	12,944.00	0.04
143	002532	天山铝业	800	12,944.00	0.04
144	600029	南方航空	1,600	12,816.00	0.04
145	002456	欧菲光	1,200	12,744.00	0.04
146	603501	豪威集团	100	12,590.00	0.04
147	002460	赣锋锂业	200	12,578.00	0.04
148	600426	华鲁恒升	400	12,572.00	0.04
149	000878	云南铜业	600	12,306.00	0.04
150	601186	中国铁建	1,600	12,272.00	0.04
151	600570	恒生电子	400	12,060.00	0.04
152	002920	德赛西威	100	12,030.00	0.04
153	002422	科伦药业	400	11,740.00	0.04
154	000568	泸州老窖	100	11,622.00	0.04

155	000708	中信特钢	700	11,459.00	0.04
156	601633	长城汽车	500	11,315.00	0.04
157	600219	南山铝业	2,100	11,298.00	0.04
158	600346	恒力石化	500	11,265.00	0.04
159	001979	招商蛇口	1,300	11,232.00	0.04
160	601168	西部矿业	400	11,056.00	0.04
161	000933	神火股份	400	10,988.00	0.03
162	002517	恺英网络	500	10,935.00	0.03
163	000630	铜陵有色	1,800	10,818.00	0.03
164	600372	中航机载	800	10,736.00	0.03
165	600515	海南机场	2,000	10,660.00	0.03
166	600588	用友网络	800	10,608.00	0.03
167	002436	兴森科技	500	10,585.00	0.03
168	600886	国投电力	800	10,496.00	0.03
169	600482	中国动力	500	10,350.00	0.03
170	002129	TCL中环	1,200	10,284.00	0.03
171	300017	网宿科技	1,000	10,250.00	0.03
172	001965	招商公路	1,000	10,080.00	0.03
173	002001	新和成	400	10,076.00	0.03
174	002273	水晶光电	400	10,048.00	0.03
175	601800	中国交建	1,200	9,888.00	0.03
176	600989	宝丰能源	500	9,815.00	0.03
177	600143	金发科技	500	9,770.00	0.03
178	000975	山金国际	400	9,732.00	0.03
179	601888	中国中免	100	9,456.00	0.03
180	002555	三七互娱	400	9,440.00	0.03
181	601111	中国国航	1,000	9,370.00	0.03
182	002493	荣盛石化	800	9,368.00	0.03
183	300408	三环集团	200	9,150.00	0.03
184	601117	中国化学	1,200	9,036.00	0.03
185	002185	华天科技	800	8,776.00	0.03

186	600497	驰宏锌锗	1,200	8,772.00	0.03
187	000301	东方盛虹	800	8,712.00	0.03
188	600392	盛和资源	400	8,612.00	0.03
189	600176	中国巨石	500	8,550.00	0.03
190	600879	航天电子	400	8,528.00	0.03
190	600352	浙江龙盛	800	8,528.00	0.03
191	601618	中国中冶	2,800	8,316.00	0.03
192	688223	晶科能源	1,461	8,240.04	0.03
193	600233	圆通速递	500	8,210.00	0.03
194	002202	金风科技	400	8,160.00	0.03
195	601872	招商轮船	900	8,082.00	0.03
196	601319	中国人保	900	8,055.00	0.03
197	600741	华域汽车	400	8,000.00	0.03
198	600039	四川路桥	800	7,960.00	0.03
199	002078	太阳纸业	500	7,875.00	0.02
200	600256	广汇能源	1,600	7,872.00	0.02
201	002738	中矿资源	100	7,855.00	0.02
202	002601	龙佰集团	400	7,832.00	0.02
203	601689	拓普集团	100	7,718.00	0.02
204	600160	巨化股份	200	7,684.00	0.02
205	000617	中油资本	800	7,680.00	0.02
206	300122	智飞生物	400	7,548.00	0.02
207	002065	东华软件	800	7,320.00	0.02
208	000932	华菱钢铁	1,300	7,306.00	0.02
209	601615	明阳智能	500	7,240.00	0.02
210	002405	四维图新	800	7,208.00	0.02
211	000066	中国长城	500	7,205.00	0.02
212	600183	生益科技	100	7,141.00	0.02
213	002648	卫星化学	400	7,072.00	0.02
214	600674	川投能源	500	6,950.00	0.02
215	601233	桐昆股份	400	6,884.00	0.02

216	002271	东方雨虹	500	6,795.00	0.02
217	300012	华测检测	500	6,775.00	0.02
218	600096	云天化	200	6,682.00	0.02
219	000977	浪潮信息	100	6,660.00	0.02
220	300251	光线传媒	400	6,552.00	0.02
221	600161	天坛生物	400	6,536.00	0.02
222	601238	广汽集团	800	6,528.00	0.02
223	688126	沪硅产业	296	6,405.44	0.02
224	002085	万丰奥威	400	6,404.00	0.02
225	300003	乐普医疗	400	6,324.00	0.02
226	002465	海格通信	400	6,300.00	0.02
227	002410	广联达	500	6,290.00	0.02
228	600208	衢州发展	1,600	6,192.00	0.02
229	300568	星源材质	400	6,100.00	0.02
230	600885	宏发股份	200	6,080.00	0.02
230	600177	雅戈尔	800	6,080.00	0.02
231	000683	博源化工	800	5,952.00	0.02
232	601868	中国能建	2,500	5,875.00	0.02
233	002414	高德红外	400	5,868.00	0.02
234	600026	中远海能	500	5,840.00	0.02
235	300002	神州泰岳	500	5,760.00	0.02
236	002459	晶澳科技	500	5,725.00	0.02
237	600460	士兰微	200	5,682.00	0.02
238	601877	正泰电器	200	5,578.00	0.02
239	002466	天齐锂业	100	5,538.00	0.02
240	300459	汤姆猫	1,200	5,508.00	0.02
241	002064	华峰化学	500	5,500.00	0.02
242	300142	沃森生物	500	5,455.00	0.02
243	600170	上海建工	2,000	5,300.00	0.02
244	600516	方大炭素	900	5,121.00	0.02
245	002938	鹏鼎控股	100	5,058.00	0.02

246	000039	中集集团	500	5,045.00	0.02
247	600704	物产中大	900	5,013.00	0.02
248	300383	光环新网	400	5,004.00	0.02
249	300450	先导智能	100	4,998.00	0.02
250	000629	钒钛股份	1,600	4,960.00	0.02
251	002294	信立泰	100	4,955.00	0.02
252	300339	润和软件	100	4,950.00	0.02
253	600637	东方明珠	500	4,925.00	0.02
254	002176	江特电机	500	4,870.00	0.02
255	000415	渤海租赁	1,200	4,860.00	0.02
256	600398	海澜之家	800	4,840.00	0.02
257	600008	首创环保	1,600	4,800.00	0.02
258	002044	美年健康	900	4,752.00	0.02
259	603077	和邦生物	2,100	4,746.00	0.02
260	601018	宁波港	1,300	4,719.00	0.01
261	600166	福田汽车	1,600	4,672.00	0.01
262	000831	中国稀土	100	4,644.00	0.01
263	600153	建发股份	500	4,625.00	0.01
264	601179	中国西电	500	4,550.00	0.01
265	002739	万达电影	400	4,528.00	0.01
266	601880	辽港股份	2,800	4,480.00	0.01
267	300253	卫宁健康	500	4,410.00	0.01
267	002145	钛能化学	900	4,410.00	0.01
268	600895	张江高科	100	4,390.00	0.01
269	002607	中公教育	1,600	4,384.00	0.01
270	002312	川发龙蟒	400	4,372.00	0.01
271	688599	天合光能	261	4,319.55	0.01
272	300418	昆仑万维	100	4,170.00	0.01
273	002008	大族激光	100	4,119.00	0.01
274	600998	九州通	800	4,096.00	0.01
275	002244	滨江集团	400	4,020.00	0.01

276	000069	华侨城A	1,600	3,968.00	0.01
277	600004	白云机场	400	3,784.00	0.01
278	300054	鼎龙股份	100	3,760.00	0.01
279	600745	闻泰科技	100	3,728.00	0.01
280	300024	机器人	200	3,638.00	0.01
281	002138	顺络电子	100	3,553.00	0.01
282	600141	兴发集团	100	3,458.00	0.01
283	601000	唐山港	900	3,456.00	0.01
284	002444	巨星科技	100	3,402.00	0.01
285	600325	华发股份	800	3,376.00	0.01
286	002266	浙富控股	800	3,328.00	0.01
287	002624	完美世界	200	3,278.00	0.01
288	601866	中远海发	1,300	3,276.00	0.01
288	300144	宋城演艺	400	3,276.00	0.01
289	600867	通化东宝	400	3,268.00	0.01
290	600820	隧道股份	500	3,245.00	0.01
291	600667	太极实业	400	3,188.00	0.01
292	600699	均胜电子	100	3,136.00	0.01
292	300070	碧水源	800	3,136.00	0.01
293	002007	华兰生物	200	3,026.00	0.01
294	601677	明泰铝业	200	2,958.00	0.01
295	002318	久立特材	100	2,895.00	0.01
296	000999	华润三九	100	2,846.00	0.01
297	605589	圣泉集团	100	2,830.00	0.01
298	002128	电投能源	100	2,791.00	0.01
299	000960	锡业股份	100	2,788.00	0.01
300	600499	科达制造	200	2,774.00	0.01
301	002152	广电运通	200	2,762.00	0.01
302	000035	中国天楹	500	2,760.00	0.01
303	300285	国瓷材料	100	2,741.00	0.01
304	603659	璞泰来	100	2,734.00	0.01

305	002120	韵达股份	400	2,696.00	0.01
306	600864	哈投股份	400	2,652.00	0.01
307	002130	沃尔核材	100	2,632.00	0.01
308	000400	许继电气	100	2,571.00	0.01
309	300001	特锐德	100	2,568.00	0.01
310	600655	豫园股份	500	2,565.00	0.01
311	603568	伟明环保	100	2,538.00	0.01
312	688009	中国通号	457	2,499.79	0.01
313	000786	北新建材	100	2,497.00	0.01
314	002497	雅化集团	100	2,475.00	0.01
315	300413	芒果超媒	100	2,442.00	0.01
316	002389	航天彩虹	100	2,398.00	0.01
317	600862	中航高科	100	2,363.00	0.01
318	000887	中鼎股份	100	2,321.00	0.01
319	601567	三星医疗	100	2,302.00	0.01
320	603939	益丰药房	100	2,172.00	0.01
321	000738	航发控制	100	2,131.00	0.01
322	600803	新奥股份	100	2,076.00	0.01
323	600845	宝信软件	100	2,071.00	0.01
324	002180	纳思达	100	2,022.00	0.01
325	600529	山东药玻	100	1,993.00	0.01
326	000623	吉林敖东	100	1,953.00	0.01
327	600765	中航重机	100	1,916.00	0.01
328	000519	中兵红箭	100	1,821.00	0.01
329	601607	上海医药	100	1,786.00	0.01
330	002245	蔚蓝锂芯	100	1,780.00	0.01
331	600312	平高电气	100	1,735.00	0.01
332	002603	以岭药业	100	1,707.00	0.01
333	600521	华海药业	100	1,697.00	0.01
334	600258	首旅酒店	100	1,675.00	0.01
335	000830	鲁西化工	100	1,657.00	0.01

336	300068	南都电源	100	1,554.00	0.00
337	600859	王府井	100	1,553.00	0.00
338	600535	天士力	100	1,507.00	0.00
339	603885	吉祥航空	100	1,488.00	0.00
340	300601	康泰生物	100	1,477.00	0.00
341	000967	盈峰环境	200	1,468.00	0.00
342	300118	东方日升	100	1,466.00	0.00
343	601966	玲珑轮胎	100	1,453.00	0.00
344	603806	福斯特	100	1,396.00	0.00
345	601155	新城控股	100	1,395.00	0.00
346	002572	索菲亚	100	1,361.00	0.00
347	000998	隆平高科	100	936.00	0.00
348	002091	江苏国泰	100	903.00	0.00
349	002292	奥飞娱乐	100	885.00	0.00

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000893	亚钾国际	5,600	268,632.00	0.85
2	601808	中海油服	17,800	249,912.00	0.79
3	601609	金田股份	23,100	249,480.00	0.79
4	002707	众信旅游	33,900	243,741.00	0.77
5	000682	东方电子	20,500	243,130.00	0.77
6	000895	双汇发展	8,800	232,936.00	0.74
7	001391	国货航	39,300	232,656.00	0.74
8	601881	中国银河	13,900	218,508.00	0.69
9	601717	中创智领	7,700	189,035.00	0.60
10	002237	恒邦股份	12,900	173,118.00	0.55
11	300953	震裕科技	1,000	168,020.00	0.53

12	300999	金龙鱼	5,800	166,692.00	0.53
13	603948	建业股份	5,500	150,150.00	0.48
14	603103	横店影视	9,000	149,220.00	0.47
15	000876	新希望	15,600	143,832.00	0.46
16	300857	协创数据	800	134,944.00	0.43
17	600377	宁沪高速	10,400	125,944.00	0.40
18	600866	星湖科技	15,800	109,810.00	0.35
19	002096	易普力	7,000	93,240.00	0.30
20	600919	江苏银行	8,400	87,360.00	0.28
21	000060	中金岭南	14,800	86,580.00	0.27
22	600025	华能水电	6,400	58,112.00	0.18
23	688819	天能股份	1,700	56,474.00	0.18
24	300644	南京聚隆	1,400	51,674.00	0.16
25	603927	中科软	2,400	45,816.00	0.15
26	600221	海航控股	23,300	42,173.00	0.13
27	601901	方正证券	4,700	36,660.00	0.12
28	002987	京北方	1,700	36,601.00	0.12
29	301631	壹连科技	300	31,065.00	0.10
30	000166	申万宏源	4,300	22,661.00	0.07
31	601991	大唐发电	6,200	21,638.00	0.07
32	000422	湖北宜化	1,400	19,894.00	0.06
33	601878	浙商证券	800	8,648.00	0.03
34	601298	青岛港	900	7,506.00	0.02

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	8,989,156.00	28.51

2	601318	中国平安	5,845,452.68	18.54
3	300750	宁德时代	5,292,760.00	16.79
4	002463	沪电股份	4,187,621.00	13.28
5	600030	中信证券	3,631,684.00	11.52
6	601398	工商银行	3,413,885.00	10.83
7	000858	五粮液	3,173,439.00	10.06
8	002594	比亚迪	3,143,480.00	9.97
9	601288	农业银行	3,059,181.00	9.70
10	300394	天孚通信	3,010,850.00	9.55
11	000651	格力电器	2,971,874.00	9.43
12	002475	立讯精密	2,879,148.00	9.13
13	600036	招商银行	2,841,895.00	9.01
14	600941	中国移动	2,813,741.00	8.92
15	601668	中国建筑	2,770,473.00	8.79
16	000001	平安银行	2,730,107.00	8.66
17	300308	中际旭创	2,586,902.00	8.20
18	300502	新易盛	2,562,733.00	8.13
19	601728	中国电信	2,560,549.00	8.12
20	601766	中国中车	2,442,988.30	7.75
21	002352	顺丰控股	2,406,864.00	7.63
22	000063	中兴通讯	2,357,998.60	7.48
23	600150	中国船舶	2,337,431.72	7.41
24	600028	中国石化	2,277,809.00	7.22
25	600031	三一重工	2,270,568.00	7.20
26	000100	TCL科技	2,210,770.00	7.01
27	601727	上海电气	2,204,600.00	6.99
28	601600	中国铝业	2,200,709.00	6.98
29	000538	云南白药	2,198,678.40	6.97
30	000333	美的集团	2,158,613.00	6.85
31	603501	豪威集团	2,140,354.00	6.79
32	603019	中科曙光	2,138,237.00	6.78

33	600332	白云山	2,136,036.00	6.77
34	002156	通富微电	2,131,182.30	6.76
35	600839	四川长虹	2,102,930.00	6.67
36	000338	潍柴动力	2,071,288.00	6.57
37	601127	赛力斯	1,980,122.00	6.28
38	601988	中国银行	1,977,024.00	6.27
39	601006	大秦铁路	1,959,538.00	6.21
40	300015	爱尔眼科	1,951,888.00	6.19
41	600038	中直股份	1,943,337.00	6.16
42	688981	中芯国际	1,872,750.57	5.94
43	688256	寒武纪	1,871,280.11	5.93
44	002384	东山精密	1,842,376.00	5.84
45	601069	西部黄金	1,841,482.00	5.84
46	000625	长安汽车	1,831,478.00	5.81
47	688041	海光信息	1,798,623.84	5.70
48	000725	京东方A	1,790,354.00	5.68
49	300475	香农芯创	1,776,390.00	5.63
50	002252	上海莱士	1,766,075.00	5.60
51	600048	保利发展	1,755,447.00	5.57
52	003816	中国广核	1,726,446.00	5.48
53	600489	中金黄金	1,724,668.00	5.47
54	600183	生益科技	1,690,806.00	5.36
55	000426	兴业银锡	1,661,199.00	5.27
56	601319	中国人保	1,649,923.00	5.23
57	002340	格林美	1,625,246.00	5.15
58	601989	中国重工（退市）	1,612,780.00	5.11
59	601166	兴业银行	1,609,629.00	5.10
60	600196	复星医药	1,587,326.00	5.03
61	600219	南山铝业	1,584,732.00	5.03
62	300207	欣旺达	1,571,147.00	4.98
63	601607	上海医药	1,550,512.00	4.92

64	300058	蓝色光标	1,531,637.00	4.86
65	002065	东华软件	1,530,598.00	4.85
66	002202	金风科技	1,517,750.00	4.81
67	600039	四川路桥	1,508,094.00	4.78
68	000009	中国宝安	1,494,831.00	4.74
69	000830	鲁西化工	1,493,211.00	4.74
70	300274	阳光电源	1,476,850.00	4.68
71	600177	雅戈尔	1,475,899.00	4.68
72	601238	广汽集团	1,475,346.00	4.68
73	002707	众信旅游	1,432,529.00	4.54
74	600511	国药股份	1,407,809.00	4.46
75	601899	紫金矿业	1,397,490.00	4.43
76	000166	申万宏源	1,381,880.00	4.38
77	600583	海油工程	1,380,732.00	4.38
78	000937	冀中能源	1,378,790.00	4.37
79	000876	新希望	1,366,177.00	4.33
80	600377	宁沪高速	1,362,578.00	4.32
81	600100	同方股份	1,357,417.00	4.30
82	002608	江苏国信	1,353,627.00	4.29
83	601818	光大银行	1,351,296.00	4.29
84	601061	中信金属	1,349,166.00	4.28
85	000883	湖北能源	1,347,368.00	4.27
86	600061	国投资本	1,343,830.00	4.26
87	000425	徐工机械	1,319,319.00	4.18
88	002371	北方华创	1,308,221.00	4.15
89	300476	胜宏科技	1,285,923.00	4.08
90	300059	东方财富	1,278,752.00	4.06
91	600900	长江电力	1,246,334.00	3.95
92	601328	交通银行	1,240,991.00	3.94
93	688578	艾力斯	1,211,397.12	3.84
94	601816	京沪高铁	1,197,742.00	3.80

95	002230	科大讯飞	1,127,107.50	3.57
96	601186	中国铁建	1,098,095.00	3.48
97	001979	招商蛇口	1,072,750.00	3.40
98	601088	中国神华	1,070,289.00	3.39
99	600887	伊利股份	1,006,453.00	3.19
100	601678	滨化股份	995,430.00	3.16
101	300088	长信科技	969,854.62	3.08
102	300999	金龙鱼	962,288.00	3.05
103	600406	国电南瑞	939,077.00	2.98
104	000893	亚钾国际	920,306.98	2.92
105	600118	中国卫星	896,401.00	2.84
106	000938	紫光股份	884,442.00	2.80
107	603986	兆易创新	861,650.00	2.73
108	600276	恒瑞医药	826,881.00	2.62
109	300033	同花顺	816,215.00	2.59
110	000988	华工科技	800,784.00	2.54
111	600011	华能国际	782,774.00	2.48
111 2	603799	华友钴业	769,343.00	2.44
113	600362	江西铜业	753,158.00	2.39
114	300251	光线传媒	748,091.00	2.37
115	600010	包钢股份	745,378.00	2.36
116	600584	长电科技	738,599.00	2.34
117	688520	神州细胞	737,300.18	2.34
118	601601	中国太保	732,488.00	2.32
119	601939	建设银行	707,948.00	2.25
120	688617	惠泰医疗	695,023.94	2.20
121	300857	协创数据	687,287.00	2.18
122	300953	震裕科技	672,186.00	2.13
123	301325	曼恩斯特	666,945.00	2.12
124	601881	中国银河	665,670.00	2.11

125	600795	国电电力	651,370.00	2.07
126	600460	士兰微	647,167.00	2.05

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

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	8,269,379.34	26.23
2	601318	中国平安	5,619,256.00	17.82
3	300750	宁德时代	5,024,612.00	15.94
4	002463	沪电股份	4,419,103.00	14.01
5	600030	中信证券	3,355,176.00	10.64
6	601288	农业银行	3,217,365.00	10.20
7	002475	立讯精密	3,161,796.00	10.03
8	601398	工商银行	2,962,081.00	9.39
9	300394	天孚通信	2,943,219.00	9.33
10	000858	五粮液	2,942,115.00	9.33
11	300502	新易盛	2,702,342.00	8.57
12	300308	中际旭创	2,685,431.00	8.52
13	601668	中国建筑	2,632,132.00	8.35
14	000063	中兴通讯	2,579,023.00	8.18
15	600941	中国移动	2,570,463.00	8.15
16	000651	格力电器	2,548,080.00	8.08
17	603019	中科曙光	2,544,120.00	8.07
18	002594	比亚迪	2,522,519.00	8.00
19	600036	招商银行	2,509,986.00	7.96
20	601600	中国铝业	2,498,402.00	7.92
21	688041	海光信息	2,435,911.84	7.73
22	000001	平安银行	2,299,335.00	7.29

23	600031	三一重工	2,292,186.00	7.27
24	600028	中国石化	2,256,969.00	7.16
25	603501	豪威集团	2,248,162.00	7.13
26	601728	中国电信	2,207,716.00	7.00
27	600839	四川长虹	2,188,657.00	6.94
28	601766	中国中车	2,135,361.70	6.77
29	300475	香农芯创	2,134,761.00	6.77
30	002384	东山精密	2,111,039.00	6.69
31	601727	上海电气	2,093,400.00	6.64
32	600183	生益科技	2,068,175.00	6.56
33	002156	通富微电	2,040,432.81	6.47
34	000538	云南白药	1,984,028.00	6.29
35	600489	中金黄金	1,968,932.00	6.24
36	000100	TCL科技	1,958,822.00	6.21
37	002352	顺丰控股	1,952,295.00	6.19
38	600332	白云山	1,904,400.00	6.04
39	601006	大秦铁路	1,898,153.00	6.02
40	000338	潍柴动力	1,893,314.00	6.00
41	002202	金风科技	1,885,763.00	5.98
42	601127	赛力斯	1,873,397.00	5.94
43	600038	中直股份	1,869,822.00	5.93
44	601988	中国银行	1,866,147.00	5.92
45	600150	中国船舶	1,834,402.24	5.82
46	000625	长安汽车	1,791,425.00	5.68
47	601069	西部黄金	1,789,629.00	5.68
48	300207	欣旺达	1,774,955.00	5.63
49	600048	保利发展	1,771,430.00	5.62
50	688256	寒武纪	1,719,067.80	5.45
51	002340	格林美	1,714,792.00	5.44
52	300015	爱尔眼科	1,674,086.00	5.31
53	688981	中芯国际	1,672,619.48	5.30

54	601319	中国人保	1,667,724.00	5.29
55	000333	美的集团	1,658,065.00	5.26
56	600219	南山铝业	1,649,192.00	5.23
57	601989	中国重工（退市）	1,645,984.72	5.22
58	002065	东华软件	1,632,293.00	5.18
59	000830	鲁西化工	1,619,947.00	5.14
60	000426	兴业银锡	1,605,929.00	5.09
61	601061	中信金属	1,601,924.00	5.08
62	300058	蓝色光标	1,576,451.20	5.00
63	601607	上海医药	1,532,868.00	4.86
64	600196	复星医药	1,528,130.00	4.85
65	003816	中国广核	1,512,109.00	4.80
66	600039	四川路桥	1,509,477.00	4.79
67	002252	上海莱士	1,504,195.00	4.77
68	601238	广汽集团	1,485,025.00	4.71
69	600100	同方股份	1,469,506.00	4.66
70	600177	雅戈尔	1,465,878.00	4.65
71	601166	兴业银行	1,455,787.00	4.62
72	000725	京东方A	1,435,808.00	4.55
73	600061	国投资本	1,423,225.00	4.51
74	000009	中国宝安	1,418,948.89	4.50
75	000425	徐工机械	1,416,685.00	4.49
76	688578	艾力斯	1,409,148.48	4.47
77	002371	北方华创	1,399,022.00	4.44
78	000166	申万宏源	1,395,899.00	4.43
79	601899	紫金矿业	1,386,084.00	4.40
80	002608	江苏国信	1,385,942.00	4.40
81	600583	海油工程	1,365,366.00	4.33
82	000883	湖北能源	1,343,650.00	4.26
83	000937	冀中能源	1,341,518.00	4.25
84	600511	国药股份	1,311,126.00	4.16

85	601818	光大银行	1,289,281.00	4.09
86	300059	东方财富	1,265,660.00	4.01
87	000876	新希望	1,218,257.00	3.86
88	002707	众信旅游	1,176,466.00	3.73
89	600377	宁沪高速	1,154,719.00	3.66
90	600900	长江电力	1,140,195.00	3.62
91	300274	阳光电源	1,127,282.00	3.58
92	001979	招商蛇口	1,098,644.00	3.48
93	601816	京沪高铁	1,098,496.00	3.48
94	601186	中国铁建	1,072,261.99	3.40
95	600118	中国卫星	1,019,815.00	3.23
96	601088	中国神华	1,015,595.00	3.22
97	601328	交通银行	993,464.00	3.15
98	601678	滨化股份	985,416.00	3.13
99	600406	国电南瑞	937,620.52	2.97
100	600362	江西铜业	934,074.00	2.96
101	300088	长信科技	929,697.00	2.95
102	603799	华友钴业	910,534.00	2.89
103	300476	胜宏科技	908,963.00	2.88
104	603986	兆易创新	875,642.00	2.78
105	002230	科大讯飞	862,952.00	2.74
106	300999	金龙鱼	811,906.00	2.57
107	600276	恒瑞医药	792,468.00	2.51
108	688520	神州细胞	766,666.22	2.43
109	688617	惠泰医疗	731,322.55	2.32
110	000893	亚钾国际	730,840.00	2.32
111	301325	曼恩斯特	673,872.00	2.14
112	300251	光线传媒	673,481.00	2.14
113	000977	浪潮信息	672,836.00	2.13
114	601939	建设银行	671,838.00	2.13
115	000737	北方铜业	666,799.00	2.11

116	301358	湖南裕能	631,474.00	2.00
-----	--------	------	------------	------

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

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	275,019,283.81
卖出股票收入（成交）总额	258,148,587.98

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

8.5 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。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与国债期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。套期保值主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

8.12 投资组合报告附注

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

8.12.2 报告期内，本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,565.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,565.40

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不存在流通受限情况。

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不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

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
财通中证A500指数增强A	755	21,245.32	0.00	0.00%	16,040,219.68	100.00%
财通中证A500指数增强C	292	42,129.20	310,064.48	2.52%	11,991,660.60	97.48%
合计	1,047	27,069.67	310,064.48	1.09%	28,031,880.28	98.91%

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

9.2 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	占基金总份额比
----	------	--------	---------

		(份)	例
基金管理人所有从业人员持有本基金	财通中证A500指数增强A	1,000.03	0.01%
	财通中证A500指数增强C	10,002.44	0.08%
	合计	11,002.47	0.04%

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

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	财通中证A500指数增强A	财通中证A500指数增强C
基金合同生效日(2025年06月26日)基金份额总额	248,493,700.48	164,658,108.72
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	13,101,322.88	13,662,312.18
减：基金合同生效日起至报告期	245,554,803.68	166,018,695.82

期末基金总赎回份额		
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	16,040,219.68	12,301,725.08

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内，本基金管理人于2025年5月14日聘任刘江女士担任总经理助理职务，于2025年7月28日聘任沈健先生担任总经理助理职务。

2、本报告期基金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

本基金本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未改聘会计师事务所，应支付给毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）的审计费用为24,000.00元。目前该事务所已为本基金提供审计服务1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

管理人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	财通基金管理有限公司
受到调查或处罚等措施的时间	2025年01月07日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会上海监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	责令改正

受到调查或处罚等措施的原因	投资运作
受到处罚的依据	《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	截至报告期末，管理人已采取整改措施，如完善业务管理等，整改成果已经上海证监局验收通过，已被上海证监局解除措施。
其他	无

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

管理人相关从业人员受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	高级管理人员
受到调查或处罚等措施的时间	2025年01月07日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会上海监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	出具警示函
受到调查或处罚等措施的原因	投资运作
受到处罚的依据	《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	截至报告期末，管理人已采取整改措施，如完善业务管理等，整改成果已经上海证监局验收通过，已被上海证监局解除措施。
其他	无

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人未因托管业务受调查或处罚。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人相关从业人员未受调查或处罚。

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	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股	佣金	占当期佣	

	单元数量		票成交总额的 比例		金总量的 比例	
财通 证券	2	191,505,626.67	36.13%	44,326.21	40.06%	-
中邮 证券	2	338,566,055.68	63.87%	66,328.09	59.94%	-

注：1、选择证券公司参与证券交易的标准

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

- (1)经营行为规范、合规内控制度健全；
- (2)具备高效、安全运作的通讯条件和稳定的交易系统，满足基金投资交易需求；
- (3)具备良好的市场形象和财务状况；
- (4)具备较强的研究及综合服务能力，具有专门的研究机构和专职研究人员；
- (5)被动股票型基金选择合作券商原则上应优先考虑交易服务能力。

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

2、选择证券公司参与证券交易的程序

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

3、本基金管理人网站披露的《财通基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025年度）》的统计范围为报告期间存续过的所有公募基金，包括报告期间成立、清算、转型的公募基金。敬请投资者关注上述报告统计范围的口径差异。

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
财通证券	-	-	1,910,000,000.00	100.00%	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	财通中证A500指数增强型证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒介	2025-05-30
2	财通中证A500指数增强型证券投资基金托管协议	中国证监会规定媒介	2025-05-30
3	财通中证A500指数增强型证券投资基金招募说明书	中国证监会规定媒介	2025-05-30
4	财通中证A500指数增强型证券投资基金基金产品资料概要	中国证监会规定媒介	2025-05-30
5	财通中证A500指数增强型证券投资基金基金份额发售公告	中国证监会规定媒介	2025-05-30
6	财通中证A500指数增强型证券投资基金风险揭示书	中国证监会规定媒介	2025-05-30
7	关于财通中证A500指数增强型证券投资基金A类基金份额开展直销认购费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2025-06-10

8	财通基金管理有限公司关于财通中证A500指数增强型证券投资基金提前结束募集的公告	中国证监会规定媒介	2025-06-12
9	财通中证A500指数增强型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会规定媒介	2025-06-27
10	财通基金管理有限公司旗下公开募集证券投资基金2025年风险评价结果的公告	中国证监会规定媒介	2025-07-30
11	关于财通中证A500指数增强型证券投资基金开放日常申购（含定期定额投资）、赎回及转换业务并开展直销费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2025-08-02
12	财通中证A500指数增强型证券投资基金2025年第3季度报告	中国证监会规定媒介	2025-10-28
13	关于天津市润泽基金销售有限公司终止代理销售财通基金管理有限公司旗下基金的公告	中国证监会规定媒介	2025-12-13

§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

本基金本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

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、中国证监会准予基金注册的文件；

- 2、财通中证A500指数增强型证券投资基金基金合同；
- 3、财通中证A500指数增强型证券投资基金托管协议；
- 4、财通中证A500指数增强型证券投资基金招募说明书及其更新；
- 5、报告期内披露的各项公告；
- 6、法律法规要求备查的其他文件。

13.2 存放地点

上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心43、45楼。

13.3 查阅方式

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

咨询电话：400-820-9888

公司网址：www.ctfund.com

财通基金管理有限公司
二〇二六年三月三十一日