

海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
2025 年年度报告
2025 年 12 月 31 日

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年三月三十一日

§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。

基金托管人上海浦东发展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 1 月 22 日（基金合同生效日）起至 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
§ 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	6
§ 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	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	13
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	16
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遵规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
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	17
§ 6 审计报告	17
6.1 审计意见	17
6.2 形成审计意见的基础	17
6.3 其他信息	18
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任	18
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任	18
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	21
7.3 净资产变动表	22
7.4 报表附注	23
§ 8 投资组合报告	50
8.1 期末基金资产组合情况	50
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	51
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	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	63

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	66
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	66
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	66
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	66
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	66
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	66
8.12 投资组合报告附注	67
§ 9 基金份额持有人信息	68
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	68
9.2 期末上市基金前十名持有人	68
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	69
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	69
§ 10 开放式基金份额变动	69
§ 11 重大事件揭示	69
11.1 基金份额持有人大会决议	69
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	69
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	70
11.4 基金投资策略的改变	70
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	70
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	70
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	71
11.8 其他重大事件	72
12 影响投资者决策的其他重要信息	75
§ 13 备查文件目录	76
13.1 备查文件目录	76
13.2 存放地点	77
13.3 查阅方式	77

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	海富通中证 A500ETF
场内简称	中证 A500ETF 海富通
基金主代码	563860
交易代码	563860
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 1 月 22 日
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	323,844,300.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2025 年 2 月 12 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用被动指数化投资策略，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要投资策略包括股票投资策略，债券投资策略，可转换债券和可交换债券投资策略，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策略，存托凭证投资策略等
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		海富通基金管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	岳冲	朱萍
	联系电话	021-38650788	021-31888888
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	Zhup02@spdb.com.cn
客户服务电话		40088-40099	95528
传真		021-33830166	021-63602540
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 18 层 1802-1803 室以及 19 层 1901-1908 室	上海市中山东一路 12 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 18 层 1802-1803 室以及 19 层 1901-1908 室	上海市博成路 1388 号浦银中心 A 栋
邮政编码		200120	200126
法定代表人		谢乐斌	张为忠

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hftfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

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)	北京市东城区东长安街 1 号东方广场毕马威大 楼 8 层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责 任公司	北京市西城区太平桥大 街 17 号

§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 1 月 22 日(基金合同生效日)至 2025 年 12 月 31 日
本期已实现收益	92,329,908.48
本期利润	158,503,476.26
加权平均基金份额本期利润	0.1961
本期加权平均净值利润率	18.68%
本期基金份额净值增长率	25.02%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末
期末可供分配利润	55,323,764.52
期末可供分配基金份额利润	0.1708
期末基金资产净值	404,861,697.91
期末基金份额净值	1.2502
3.1.3 累计期末指标	2025 年末
基金份额累计净值增长率	25.02%

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）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、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。

3、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）。

4、本基金合同生效日为 2025 年 01 月 22 日，合同生效当年期间的数据和指标按实际存续期计算。

3.2 基金净值表现

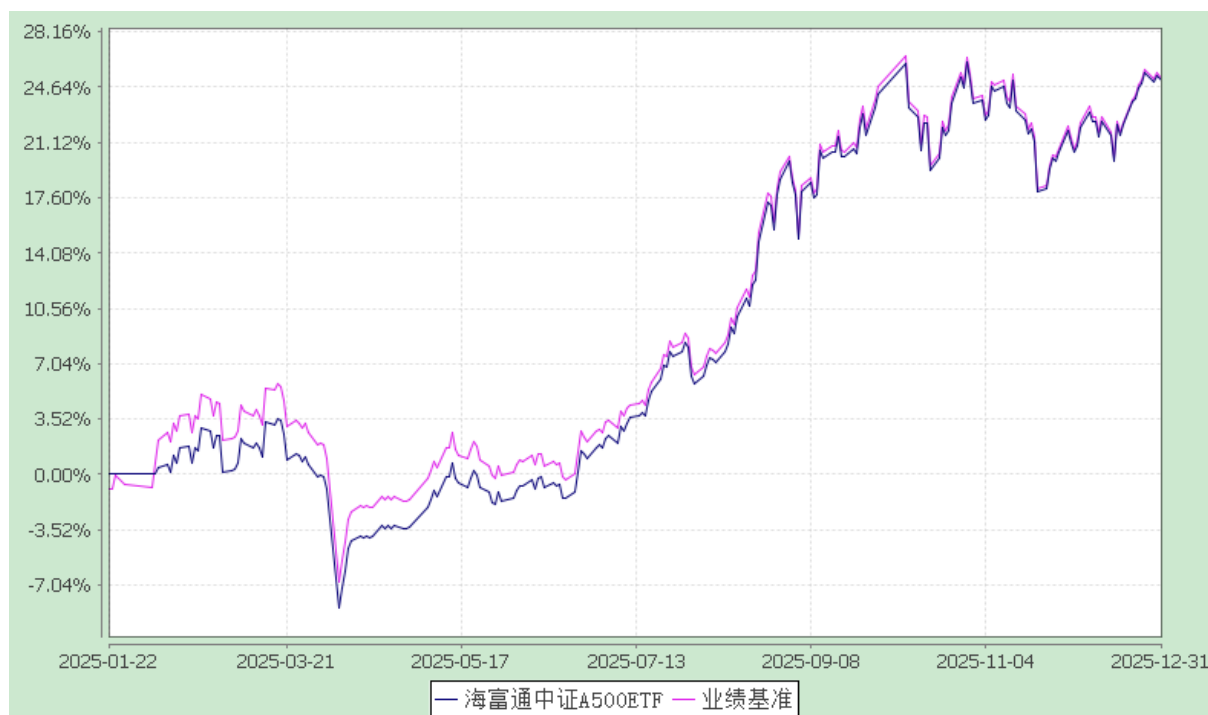
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.67%	1.03%	0.43%	1.05%	0.24%	-0.02%

月						
过去六个月	22.89%	0.98%	21.86%	1.00%	1.03%	-0.02%
自基金合同生效起至今	25.02%	1.00%	25.20%	1.04%	-0.18%	-0.04%

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

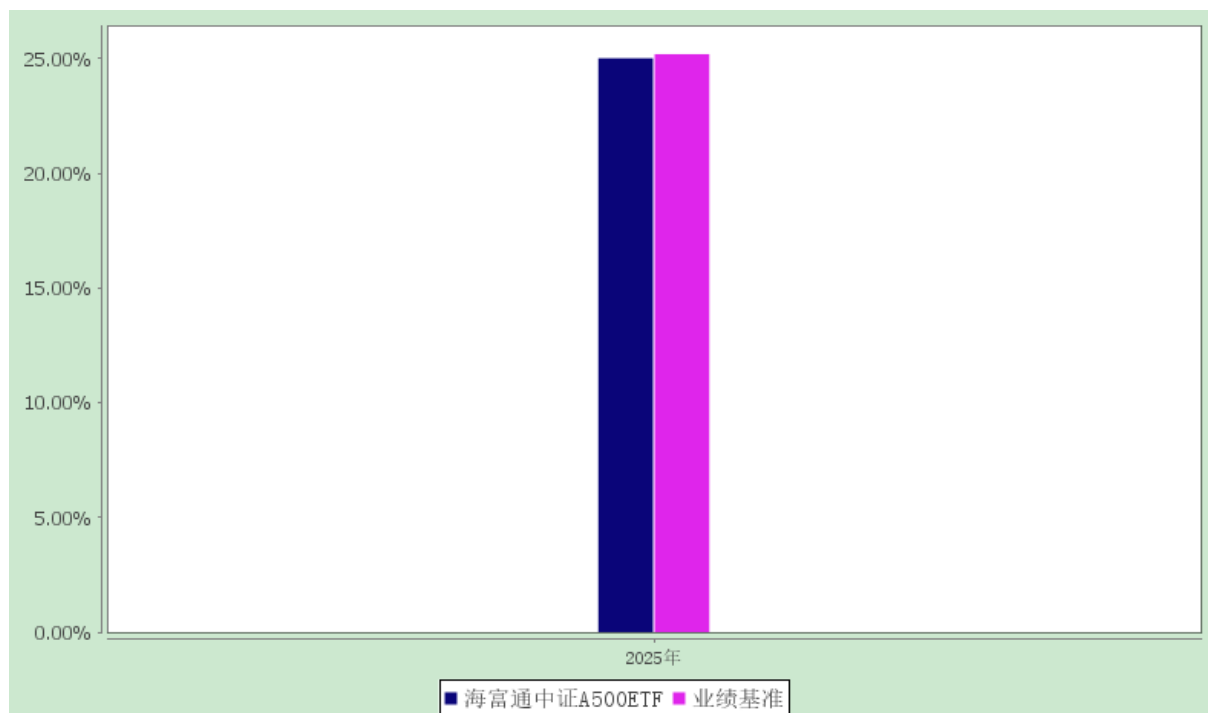
海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
 (2025 年 1 月 22 日至 2025 年 12 月 31 日)



注：1、本基金合同于 2025 年 1 月 22 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。
 2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

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

海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
 自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：图中列示的 2025 年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期 1 月 22 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2025 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：本基金自基金合同生效日（2025 年 1 月 22 日）至本报告期末未发生利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人海富通基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2003]48 号文批准，于 2003 年 4 月 1 日发起设立。目前，公司的股东为国泰海通证券股份有限公司、法国巴黎资产管理 BE 控股公司，注册资本为 3 亿元人民币。

截至 2025 年 12 月 31 日, 本基金管理人旗下运作的公募基金共有 98 只, 分别是: 海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通股票混合型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通风格优势混合型证券投资基金、海富通精选贰号混合型证券投资基金、海富通中国海外精选混合型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通领先成长混合型证券投资基金、海富通中证 A100 指数证券投资基金 (LOF)、海富通中小盘混合型证券投资基金、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通国策导向混合型证券投资基金、海富通中证 500 指数增强型证券投资基金、海富通安颐收益混合型证券投资基金、海富通一年定期开放债券型证券投资基金、海富通内需热点混合型证券投资基金、海富通纯债债券型证券投资基金、上证城投债交易型开放式指数证券投资基金、海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金、海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金、海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞丰债券型证券投资基金、海富通聚利纯债债券型证券投资基金、海富通集利纯债债券型证券投资基金、海富通全球美元收益债券型证券投资基金 (LOF)、海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞利纯债债券型证券投资基金、海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞合纯债债券型证券投资基金、海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金、海富通瑞福债券型证券投资基金、海富通瑞祥一年定期开放债券型证券投资基金、海富通添益货币市场基金、海富通聚优精选混合型基金中基金 (FOF)、海富通量化先锋股票型证券投资基金、海富通融丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金、海富通恒丰定期开放债券型发起式证券投资基金、上证 10 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通弘丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通鼎丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通电子信息传媒产业股票型证券投资基金、海富通上海清算所中高等级短期融资券指数证券投资基金、海富通研究精选混合型证券投资基金、海富通稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、海富通中短债债券型证券投资基金、海富通聚合纯债债券型证券投资基金、海富通上证 5 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通先进制造股票型证券投资基金、海富通裕通 30 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金、海富通平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、海富通科技创新混合型证券投资基金、海富通裕昇三年定期开放债券型证券投资基金、海富通瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通富盈混合型证券投资基金、海富通富泽混合型证券投资基金、海富通上证投资级可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金、海富通成长甄选混合型证券投资基金、海富通消费核心资产混合型证券投资基金、海富通成长价值混合型证券投资基金、海富通均衡甄选混合型证券投资基金、海富通欣睿混合型证券投资基金、海富通消费优选混合型证券投资基金、海富通中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、海富通策略收益债券型证券投资基金、海富通中证港股通科技交易型开放式指数证券投

资基金、海富通利率债债券型证券投资基金、海富通瑞兴 3 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通欣利混合型证券投资基金、海富通碳中和主题混合型证券投资基金、海富通成长领航混合型证券投资基金、海富通养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通恒益金融债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通盈丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通添利收益一年持有期债券型证券投资基金、海富通悦享一年持有期混合型证券投资基金、海富通产业优选混合型证券投资基金、海富通中债 0-2 年政策性金融债指数证券投资基金、海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、海富通红利优选混合型证券投资基金、海富通中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、海富通量化选股混合型证券投资基金、海富通上证基准做市公司债交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金、海富通远见回报混合型证券投资基金、海富通配置优选三个月持有期混合型基金中基金(FOF)、海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金、海富通中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、海富通致远量化选股股票型发起式证券投资基金、海富通添合收益债券型证券投资基金、海富通聚益优选三个月持有期债券型基金中基金（FOF）、海富通稳鑫三个月持有期债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
成钧	本基金的基金经理	2025-10-22	-	13 年	上海交通大学博士，南京大学和上海证券交易所博士后，持有基金从业人员资格证书。曾任职于国泰基金管理有限公司、嘉实基金管理有限公司、中国平安人寿保险股份有限公司、平安基金管理有限公司。2024 年 1 月加入海富通基金管理有限公司，曾任指数产品专家，2025 年 10 月起任海富通中证港股通科技 ETF、海富通中证 A500ETF 的基金经理。
纪君凯	本基金的基金经理	2025-01-22	-	9 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任天风证券上海自营分公司衍生品部投资研究、期权交易职位。2017 年 7 月加入海富通基金管理

					有限公司，历任投资经理、量化投资部基金经理助理。2020 年 6 月至 2023 年 7 月任海富通上证非周期 ETF、海富通上证周期 ETF 的基金经理。2020 年 7 月至 2022 年 12 月兼任海富通量化先锋股票、海富通中证 500 增强基金经理。2023 年 8 月起兼任海富通中证 A100 指数（LOF）、海富通中证港股通科技 ETF 基金经理。2024 年 4 月至 2025 年 7 月兼任海富通中证汽车零部件主题 ETF 基金经理。2024 年 6 月起兼任海富通中证港股通科技 ETF 发起联接基金经理。2025 年 1 月起兼任海富通中证 A500ETF 基金经理。
王宁宁	本基金的基金经理助理	2025-05-08	-	8 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。曾任平安道远投资管理（上海）有限公司企划财务部企划财务，平安基金管理有限公司 ETF 指数投资部指数研究员、ETF 基金经理助理，大成基金管理有限公司指数与期货投资部 ETF 基金经理助理。2024 年 5 月加入海富通基金管理有限公司，任量化投资部指数研究员。2025 年 5 月起任海富通中证港股通科技 ETF、海富通中证港股通科技 ETF 发起联接、海富通中证 A500ETF、海富通中证 2000 增强策略 ETF 的基金经理助理。

注：1、对基金的首任基金经理，其任职日期指基金合同生效日，离任日期指公司做出决定之日；非首任基金经理，其任职日期和离任日期均指公司做出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准：自参加证券行业的相关工作开始计算。

3、本公司于 2026 年 2 月 11 日发布公告，自 2026 年 2 月 9 日起，王宁宁女士不再担任本基金的基金经理助理。

4、本公司于 2026 年 3 月 10 日发布公告，自 2026 年 3 月 9 日起，纪君凯先生不再担任本基金的基金经理。

5、本公司于 2026 年 3 月 12 日发布公告，自 2026 年 3 月 11 日起，增聘王宁宁女士担任本基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金资产，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

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》等法律法规的具体要求，持续完善了公司投资交易业务流程和公平交易制度。制度和流程覆盖了一级市场和二级市场的所有投资交易管理活动以及公司内部的证券分配，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。同时，公司投资交易业务组织架构保证了各投资组合投资决策相对独立，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司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和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，保证公平交易制度的执行和实现。

报告期内，公司对旗下所有投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行了分析，并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（如 1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的样本，对其进行了 95% 置信区间，假设溢价率为 0 的 T 分布检验，结合该时间窗下组合互相之间的模拟输送金额、贡献度、交易占比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明，报告期内公司对旗下各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

经济方面，全年经济运行稳中向好。从总量看，国内 GDP 为 140.19 万亿元，实际 GDP 增速为 5.0%，增速位居世界主要经济体前列。节奏上，2025 年一季度经济实现开门红，实际 GDP 同比增长 5.4%，4 月特朗普对华发动关税战，但中国出口链竞争优势凸显，经济增长仍具韧性，二季度实际 GDP 同比增长 5.2%，三、四季度经济仍维持稳健增长。结构上，生产和出口为经济增长的亮点，2025 年规模以上工业增加值同比增长 5.9%，出口金额同比增长 5.5%。宏观政策方面，2025 年两会财政目标赤字率提高至 4.0% 左右，5 月央行降准降息，财政政策靠前发力，货币政策保持宽松，两者有力支撑经济增长。产业政策方面，国内坚持高质量发展，因地制宜发展新质生产力，科技实力和经济实力持续增强。

从 A 股市场运行来看，全年上证指数涨幅为 18.41%，沪深 300 为 17.66%，中证 500 为 30.39%，中证 800 为 20.89%，创业板指为 49.57%。行业板块方面，根据申万一级行业分类，表现靠前的板块是有色金属、通信、电子、电力设备、机械设备，表现靠后的板块是食品饮料、煤炭、美容护理、公用事业、交通运输。从行情节奏看，年初市场在 DeepSeek 催化下风险偏好提升，走出一波春季行情。但是，4 月初特朗普对等关税冲击市场，市场迎来短暂调整。此后，中美关税谈判取得积极进展，美国 OBBB 法案落地，美联储开启三轮降息。在国内外政策双宽背景下，市场迎来一波主升浪行情。从资本市场政策看，2025 年两会再提了“稳住楼市股市”，汇金等机构适时增持入市，市场信心得到提振，资本市场实现震荡上行，整体赚钱效应较好。

作为指数基金，在操作上我们严格遵守基金合同，应用指数复制策略和数量化手段提高组合与指数的拟合度，降低跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为 25.02%，同期业绩比较基准收益率为 25.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从全球经济看，2026 年主要国家如美国、德国、日本等财政政策保持积极，这是对金融市场偏友好的政策环境。但是，也需要注意到全球地缘政治风险抬升，美伊冲突导致油价高位波动，美联储降息预期也随之变化，海外金融市场可能面临更多波动风险，未来需要密切跟踪。

从国内市场看，市场有望震荡上行。随着 2024 年 9 月 24 日以来一系列政策出台，官方积极回应市场的关切，市场信心逐步修复，上证指数震荡走高。在最新中央经济工作会议中，强调“着力稳就业、稳企业、稳市场、稳预期”，稳定股市有助于稳定信心和预期，国内资本市场有望震荡上行。展望未来，我们对 A 股充满信心，宽基指数有望展现出长期配置价值与增长潜力。

作为指数基金，我们将继续秉承指数化投资策略，紧密跟踪指数，降低跟踪误差。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2025 年，基金管理人监察稽核工作根据独立、客观、公正的原则，通过业务审核、合规检查、系统监控、重点抽查、专项审计等一系列方式开展工作，强化基金运作和公司运营的合规性，督促业务部门不断改进内部控制和风险管理，并按规定定期出具监察稽核报告报董事会和公司管理层。

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核工作的重点包括以下几个方面：

一、加强合规管理，持续完善公司的规章制度体系

报告期内，公司根据法律法规、监管政策的变化，结合业务发展及内部管控需要，对公司内控制度体系进行了完善和全面梳理，新增和修订了多项内控制度和流程，进一步完善公司的内控体系，提升了公司的合规管理水平。

二、严格落实法规和监管要求，强化各项业务合规管理

报告期内，公司认真落实《推动公募基金高质量发展行动方案》等重要法律法规，进一步健全内控管理及风险控制，合规审慎地开展业务。在投研交易管理方面，公司针对监管重点关注的问题不断升级管控措施，强化了证券池管理、新股申购、投资权限管理、程序化交易、佣金管理等重点领域的合规管控措施。在产品销售营销管理方面，公司着力加强廉洁从业风险防控，进一步规范营销宣传行为，加强对外发声管理和声誉风险管理，认真落实投资者适当性和反洗钱相关要求，不断深化投资者投诉处理和投资者教育工作。运营方面，公司完善了分红业务管控措施，进一步加强了信息系统权限管理，通过数智赋能日常运营管理各业务节点，确保内控措施有效落地。

三、客观开展内外部内控评估，进一步完善内控措施

根据法规、监管要求并结合风险导向和全覆盖原则，公司加强了各业务条线合规检查，并提升了重要业务环节的合规检查频率；在专项合规检查中，聚焦行业监管关注要点，加强在投研交、销售管理、廉洁从业等方面的检查；审计工作除了开展常规审计外，针对公司重要业务开展了专项内部审计。另外，根据法规和公司管理需要，公司聘请外部专业机构对公司开展了合规有效性评估和内部控制评价审计。通过内外部结合的合规检查、评估和审计，系统审视法律法规和监管要求的落实情况、监督公司制度流程的执行情况，及时发现存在的问题并认真整改，进一步健全了公司的内部控制体系。

四、强化合规文化培训，提升员工的合规及风险意识

本报告期内，公司继续结合自身经营状况和业务特点，持续树立“合规创造价值”的核心理念，进一步加强组织各类合规培训频率，及时对新颁布的法规、监管精神和公司要求进行宣导，内容覆盖投研交易、销售、运营、廉洁从业、员工行为等方面，以使员工切实领悟法规的精神实质，将法规落实到具体的业务、工作中。同时，通过优化培训内容、丰富培训形式，增强培训的针对性和实效性，进一步强化全员的合规自觉性与执行力。

通过上述工作，本报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，维护和保障了基金份额持有人的利益。本基金管理人将继续加强内部控制和风险管理，进一步提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金财产安全、合规、诚信运作。

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》、基金合同以及中国基金业协会提供的相关估值指引对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由基金管理人与基金托管人分别独立完成。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将各类基金份额的份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

本基金管理人设立估值委员会，组成人员包括分管基金运营业务的高级管理人员、分管投资业务的高级管理人员、督察稽核部负责人、风险管理部负责人、研究部负责人及基金运营部负责人等，以上人员具有丰富的合规、风控、证券研究、会计方面的专业经验。估值委员会负责制定、更新本基金管理人管理的基金的估值政策和程序。估值委员会对经济环境发生重大变化或发生影响证券价格的重大事件进行评估，充分听取相关部门的建议，并和托管人充分协商后，提交估值建议报告，以便估值委员会决策。基金运营部按照批准后的估值政策进行估值。

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，基金管理人可每月对基金相对业绩比较基准的超额收益率以及基金的可供分配利润进行评价，收益评价日核定的基金净值增长率超过业绩比较基准同期增长率或者基金可供分配利润金额大于零时，基金管理人可进行收益分配。

本基金本报告期内未进行利润分配，但符合基金合同规定。

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

本基金本报告期无需要说明的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，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基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律、法规、基金合同、托管协议的规定，对海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现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

本报告期内，由海富通基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 审计报告

毕马威华振审字第 2600705 号

海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了后附的海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金（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 1 月 22 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。

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 1 月 22 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。

6.2 形成审计意见的基础

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。

6.3 其他信息

该基金管理人海富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。

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。

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。

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。

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

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。

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。

该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。

6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导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。

毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙） 中国注册会计师

叶凯韵 侯雯

北京市东城区东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层

2026 年 3 月 27 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

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	5,696,042.05
结算备付金		822,111.98
存出保证金		92,012.70
交易性金融资产	7.4.7.2	402,967,400.96
其中：股票投资		402,967,400.96
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		1,815,718.66
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.5	-
资产总计		411,393,286.35
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		1,203,862.55
应付赎回款		-
应付管理人报酬		60,310.24
应付托管费		20,103.40
应付销售服务费		-
应付投资顾问费		-
应交税费		12.82
应付利润		-

递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.6	5,247,299.43
负债合计		6,531,588.44
净资产：		
实收基金	7.4.7.7	323,844,300.00
未分配利润	7.4.7.8	81,017,397.91
净资产合计		404,861,697.91
负债和净资产总计		411,393,286.35

注：1、报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2502 元，基金份额总额 323,844,300.00 份。

2、基金合同成立于 2025 年 01 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

7.2 利润表

会计主体：海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 22 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 1 月 22 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
一、营业总收入		160,470,707.19
1.利息收入		1,508,626.58
其中：存款利息收入	7.4.7.9	847,780.02
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		660,846.56
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）	7.4.7.10	88,872,676.41
其中：股票投资收益		71,648,149.19
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.11	155.47
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益	7.4.7.12	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-
股利收益	7.4.7.14	17,224,371.75
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	66,173,567.78
4.汇兑收益（损失以“-”号填		-

列)		
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	3,915,836.42
减：二、营业总支出		1,967,230.93
1. 管理人报酬		1,220,392.95
其中：暂估管理人报酬（若有）		-
2. 托管费		406,797.61
3. 销售服务费		-
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失		-
7. 税金及附加		2,379.04
8. 其他费用	7.4.7.17	337,661.33
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		158,503,476.26
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		158,503,476.26
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		158,503,476.26

注：本财务报表的实际编制期间为 2025 年 01 月 22 日(基金合同生效日)至 2025 年 12 月 31 日，上年度可比期间无比较数据。

7.3 净资产变动表

会计主体：海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 22 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 1 月 22 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合 收益	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	1,937,844,300.00	-	-	1,937,844,300.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,614,000,000.00	-	81,017,397.91	-1,532,982,602.09

(一)、综合收益总额	-	-	158,503,476.26	158,503,476.26
(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)	-1,614,000,000.00	-	-77,486,078.35	-1,691,486,078.35
其中: 1. 基金申购款	531,000,000.00	-	7,935,281.45	538,935,281.45
2. 基金赎回款	-2,145,000,000.00	-	-85,421,359.80	-2,230,421,359.80
(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	323,844,300.00	-	81,017,397.91	404,861,697.91

注: 本财务报表的实际编制期间为 2025 年 01 月 22 日(基金合同生效日)至 2025 年 12 月 31 日, 上年度可比期间无比较数据。

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:

基金管理人负责人: 任志强, 主管会计工作负责人: 胡光涛, 会计机构负责人: 胡正万

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金(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[2024]1757 号《关于准予海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册, 由海富通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《海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为交易型开放式证券投资基金, 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 1,937,817,000.00 元。经向中国证监会备案, 《海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2025 年 1 月 22 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 1,937,844,300.00 份, 其中认购资金利息折合基金份额 27,300.00 份。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司,

基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为标的指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含主板、创业板及其他经中国证监会允许发行的股票）、存托凭证、债券（国债、央行票据、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、衍生工具（股指期货、股票期权、国债期货）、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且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合约、股票期权合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，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、股票期权和国债期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准：中证 A500 指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人海富通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 1 月 22 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日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 日至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2025 年 1 月 22 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，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、资产支持证券投资、衍生工具等。

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。

本基金现无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。

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 T 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。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。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。

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。

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和托管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。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产款在资金实际占用期间按实际利率法逐日确认为利息支出。

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

根据《海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的规定，本基金收益分配应遵循下列原则：基金收益分配采用现金方式；每一基金份额享有同等分配权；基金管理人可每月对基金相对业绩比较基准的超额收益率以及基金的可供分配利润

进行评价,收益评价日核定的基金净值增长率超过业绩比较基准同期增长率或者基金可供分配利润金额大于零时,基金管理人可进行收益分配;当基金收益分配根据基金相对业绩比较基准的超额收益率决定时,基于本基金的性质和特点,本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提,收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值;当基金收益分配根据基金可供分配利润金额决定时,本基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配;法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 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:

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

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

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》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》、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》、财政部 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》、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》、财政部 税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关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)对证券投资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，股权的股息、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。

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。

(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。

(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。

(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	5,696,042.05
等于：本金	5,695,645.18
加：应计利息	396.87
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-

其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	5,696,042.05

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	336,793,833.18	-	402,967,400.96	66,173,567.78
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	336,793,833.18	-	402,967,400.96	66,173,567.78

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末其他资产无余额。

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	17,156.92
其中：交易所市场	17,156.92
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	182,698.63
应付替代款	5,047,443.88
合计	5,247,299.43

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 22 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	1,937,844,300.00	1,937,844,300.00
本期申购	531,000,000.00	531,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-2,145,000,000.00	-2,145,000,000.00
本期末	323,844,300.00	323,844,300.00

注：1、本基金自 2025 年 1 月 13 日起至 2025 年 1 月 17 日止期间公开发售，共募集有效认购资金人民币 1,937,817,000.00 元，有效认购资金孳生利息人民币 27,300.00 元。

共折合为 1,937,844,300.00 份基金份额。

2、根据《海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》和《海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告》的相关规定，本基金于 2025 年 1 月 22 日(基金合同生效日)至 2025 年 2 月 11 日止期间暂不向投资人开放基金交易，申购和赎回业务自 2025 年 2 月 12 日起开始办理。投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	92,329,908.48	66,173,567.78	158,503,476.26
本期基金份额交易产生的变动数	-37,006,143.96	-40,479,934.39	-77,486,078.35
其中：基金申购款	7,704,400.20	230,881.25	7,935,281.45
基金赎回款	-44,710,544.16	-40,710,815.64	-85,421,359.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	55,323,764.52	25,693,633.39	81,017,397.91

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 22 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	135,500.09
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	639,892.52
其他	72,387.41
合计	847,780.02

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 22 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	37,098,553.89
股票投资收益——赎回差价收入	34,549,595.30
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	71,648,149.19

7.4.7.10.2 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 1 月 22 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	1,175,539,982.17
减：卖出股票成本总额	1,136,965,492.00
减：交易费用	1,475,936.28
买卖股票差价收入	37,098,553.89

7.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 22 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	2,230,421,359.80
减：现金支付赎回款总额	992,402,556.80
减：赎回股票成本总额	1,203,469,207.70
减：交易费用	-
赎回差价收入	34,549,595.30

7.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无申购差价收入。

7.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无证券出借差价收入。

7.4.7.11 债券投资收益**7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月22日（基金合同生效日）至2025年12月31日
债券投资收益——利息收入	212.47
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-57.00
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	155.47

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月22日（基金合同生效日）至2025年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	306,969.74
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	300,054.00
减：应计利息总额	6,972.74
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-57.00

7.4.7.12 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

7.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月22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	17,224,371.75
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	17,224,371.75

7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025年1月22日（基金合同生效日）至2025年12月31日
1.交易性金融资产	66,173,567.78
——股票投资	66,173,567.78
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	66,173,567.78

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月22日（基金合同生效日）至2025年12月31日
基金赎回费收入	-
替代损益	3,915,836.42
合计	3,915,836.42

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代方式申购（赎回）本基金时，补入（卖出）被替代证券的实际买入成本（实际卖出金额）与申购（赎回）确认日估值的差额，或强制退款的被替代证券在强制退款计算日与申购（赎回）确认日估值的差额。

7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月22日（基金合同生效日）至2025年12月31日
审计费用	45,000.00
信息披露费	120,000.00
证券出借违约金	-
IOPV 计算费	17,698.63
银行划款手续费	4,562.70
开户费	400.00
中登服务费	150,000.00
合计	337,661.33

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
海富通基金管理有限公司(“海富通”)	基金管理人
上海浦东发展银行股份有限公司(“浦发银行”)	基金托管人
海通证券股份有限公司(“海通证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
国泰海通证券股份有限公司(“国泰海通证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
法国巴黎资产管理 BE 控股公司 (BNP Paribas Asset Management BE Holding)	基金管理人的股东
上海国际集团有限公司	基金管理人的实际控制人
上海富诚海富通资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：1、经中国证券监督管理委员会于 2025 年 1 月 17 日出具《关于同意国泰君安

证券股份有限公司吸收合并海通证券股份有限公司并募集配套资金注册、核准国泰君安证券股份有限公司吸收合并海通证券股份有限公司、海富通基金管理有限公司变更主要股东及实际控制人、富国基金管理有限公司变更主要股东、海通期货股份有限公司变更主要股东及实际控制人的批复》（证监许可〔2025〕96号）核准，国泰君安证券股份有限公司吸收合并海通证券股份有限公司。自本次吸收合并交割日（即2025年3月14日）起，合并后的国泰君安证券股份有限公司（后更名为“国泰海通证券股份有限公司”）承继及承接海通证券股份有限公司的全部资产、负债、业务、人员、合同、资质及其他一切权利与义务，海通证券股份有限公司所持海富通基金管理有限公司（以下简称“海富通基金”）股权亦归属于国泰海通证券股份有限公司，即国泰海通证券股份有限公司成为海富通基金的主要股东，上海国际集团有限公司成为海富通基金实际控制人。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。其中，本期与海通证券发生关联交易业务时间区间为2025年1月22日至2025年3月14日，与国泰海通证券发生关联交易业务时间区间为2025年3月15日至2025年12月31日。

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1月22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
海通证券	2,076,840,440.59	58.45%
国泰海通证券	113,229,524.17	3.19%

注：基金合同成立于2025年1月22日，上年度可比期间无比较数据。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易，基金合同成立于2025年1月22日，上年度可比期间无比较数据。

7.4.10.1.3 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1月22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

海通证券	386,091.10	58.45%	-	-
国泰海通证券	21,049.65	3.19%	-	-

注：1.上述佣金按协议约定的佣金率计算，佣金率由协议签订方参考市场价格确定。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金管理人提供的证券投资研究服务等。

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。公司的该类佣金协议符合《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》。

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1月22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	1,220,392.95
其中：应支付销售机构的客户维护费	25,523.09
应支付基金管理人的净管理费	1,194,869.86

注：1、支付基金管理人海富通基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值 x0.15%/当年天数。

2、基金合同成立于 2025 年 01 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月22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	406,797.61

注：1、支付基金托管人浦发银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.05% 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：日基金托管费=前一日基金资产净值 x0.05%/当年天数。

2、基金合同成立于 2025 年 01 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

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，基金合同成立于 2025 年 1 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

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

本基金本报告期末发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务，基金合同成立于 2025 年 1 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

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

本基金本报告期末发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务，基金合同成立于 2025 年 1 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

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

份额单位：份

项目	本期 2025年1月22日（基金合同生效日）至2025年12月31日
基金合同生效日(2025年1月22日)持有的基金份额	10,000,000.00
报告期初持有的基金份额	-
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	-
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.09%

注：基金管理人投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定，基金合同成立于 2025 年 01 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末2025年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
国泰海通证券	8,431,938.00	2.6037%
合计	8,431,938.00	2.6037%

注：上述关联方投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定，基金合同成立于 2025 年 01 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

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1月22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
浦发银行	5,696,042.05	135,500.09

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券，基金合同成立于 2025 年 01 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于 2025 年 12 月 31 日，本基金持有 187,800.00 股托管人公司的 A 股普通股，成本总额为人民币 2,025,979.49 元，估值总额为人民币 2,336,232.00 元，占基金资产净值的比例为 0.58%。基金合同成立于 2025 年 1 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

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

于 2025 年 12 月 31 日，本基金未持有因认购新发或增发证券而受约束的流通受限证券。

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 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002049	紫光国微	2025-12-30	重大事项	78.81	2026-01-15	86.69	10,455	697,572.23	823,958.55	
688012	中微公司	2025-12-19	重大事项	272.72	2026-01-05	278.00	7,453	1,439,804.66	2,032,582.16	

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,本基金无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于 2025 年 12 月 31 日,本基金无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于 2025 年 12 月 31 日,本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金,紧密跟踪中证 A500 指数,具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征,其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象,采用完全复制法,跟踪中证 A500 指数,以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则,进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代,力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设,在董事会下设立审计委员会,负责制定公司的风险管理政策,审议批准公司的风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额及监督公司内部控制制度和风险管理制度的执行情况等;在管理层层面设立风险管理委员会,负责实施董事会下设审计委员会所制定的各项风险管理政策。

本基金的基金管理人建立了由督察长、风险管理委员会、风险管理部和督察稽核部

及相关业务部门风险管理责任人构成的多层次风险管理架构体系。

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于信用良好的银行，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和资产支持证券。基金合同成立于 2025 年 01 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

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。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 7.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分投资品种均能及时变现。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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。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%。

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

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

率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	5,696,042.05	-	-	-	5,696,042.05
结算备付金	822,111.98	-	-	-	822,111.98
存出保证金	92,012.70	-	-	-	92,012.70
交易性金融资产	-	-	-	402,967,400.96	402,967,400.96
应收清算款	-	-	-	1,815,718.66	1,815,718.66
资产总计	6,610,166.73	-	-	404,783,119.62	411,393,286.35
负债					
应付清算款	-	-	-	1,203,862.55	1,203,862.55
应付管理人报酬	-	-	-	60,310.24	60,310.24
应付托管费	-	-	-	20,103.40	20,103.40
应交税费	-	-	-	12.82	12.82
其他负债	-	-	-	5,247,299.43	5,247,299.43
负债总计	-	-	-	6,531,588.44	6,531,588.44
利率敏感度缺口	6,610,166.73	-	-	-398,251,531.18	404,861,697.91

注：1、表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

2、基金合同成立于 2025 年 1 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2025 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。基金合同成立于 2025 年 01 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

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交易的股票，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。

本基金采用完全复制法，跟踪中证 A500 指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中，投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。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，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	402,967,400.96	99.53
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	402,967,400.96	99.53

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2025年12月31日
	1.业绩比较基准上升 5%	23,552,665.64
	2.业绩比较基准下降 5%	-23,552,665.64

注：基金合同成立于 2025 年 01 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

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	400,110,860.25
第二层次	2,856,540.71
第三层次	-
合计	402,967,400.96

注：基金合同成立于 2025 年 1 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

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等，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，本基金分别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不会将相关股票和债券等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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

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。基金合同成立于 2025 年 1 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

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

截至资产负债表日，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	402,967,400.96	97.95
	其中：股票	402,967,400.96	97.95
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	6,518,154.03	1.58
8	其他各项资产	1,907,731.36	0.46
9	合计	411,393,286.35	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 指数投资期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,008,494.00	0.50
B	采矿业	23,687,996.00	5.85
C	制造业	252,051,130.48	62.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,727,952.55	2.40
E	建筑业	5,870,294.59	1.45
F	批发和零售业	2,479,177.00	0.61
G	交通运输、仓储和邮政业	11,153,186.77	2.75
H	住宿和餐饮业	267,050.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,546,830.21	6.31
J	金融业	54,938,119.86	13.57
K	房地产业	2,914,844.70	0.72
L	租赁和商务服务业	4,593,307.80	1.13
M	科学研究和技术服务业	4,529,561.00	1.12
N	水利、环境和公共设施管理业	784,598.88	0.19
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	177,826.00	0.04
Q	卫生和社会工作	1,083,366.12	0.27
R	文化、体育和娱乐业	684,878.00	0.17
S	综合	468,787.00	0.12
	合计	402,967,400.96	99.53

8.2.2 积极投资期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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港股通股票。

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	占基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	37,980	13,948,534.80	3.45
2	600519	贵州茅台	8,600	11,843,748.00	2.93
3	601318	中国平安	148,251	10,140,368.40	2.50
4	300308	中际旭创	16,400	10,004,000.00	2.47
5	601899	紫金矿业	232,100	8,000,487.00	1.98
6	600036	招商银行	173,430	7,301,403.00	1.80
7	300502	新易盛	14,740	6,351,171.20	1.57
8	000333	美的集团	71,000	5,548,650.00	1.37
9	601166	兴业银行	233,400	4,915,404.00	1.21
10	600900	长江电力	172,300	4,684,837.00	1.16
11	688256	寒武纪	3,301	4,474,670.55	1.11
12	300059	东方财富	176,212	4,084,594.16	1.01
13	002475	立讯精密	70,428	3,993,971.88	0.99
14	600030	中信证券	137,550	3,949,060.50	0.98
15	600276	恒瑞医药	63,520	3,783,886.40	0.93
16	002594	比亚迪	37,700	3,684,044.00	0.91
17	601398	工商银行	450,800	3,574,844.00	0.88
18	300274	阳光电源	20,160	3,448,166.40	0.85
19	688981	中芯国际	26,711	3,280,912.13	0.81
20	603259	药明康德	35,800	3,244,912.00	0.80
21	601211	国泰海通	156,796	3,222,157.80	0.80
22	601288	农业银行	399,100	3,065,088.00	0.76
23	000858	五粮液	26,600	2,818,004.00	0.70
24	601328	交通银行	371,000	2,689,750.00	0.66
25	600887	伊利股份	91,278	2,610,550.80	0.64
26	688041	海光信息	11,297	2,535,159.77	0.63
27	000651	格力电器	62,100	2,497,662.00	0.62
28	603993	洛阳钼业	122,400	2,448,000.00	0.60
29	002371	北方华创	5,200	2,387,216.00	0.59
30	600000	浦发银行	187,800	2,336,232.00	0.58
31	300476	胜宏科技	7,800	2,243,124.00	0.55
32	000725	京东方 A	515,200	2,168,992.00	0.54
33	601816	京沪高铁	413,725	2,130,683.75	0.53
34	600150	中国船舶	62,237	2,070,002.62	0.51
35	600309	万华化学	26,700	2,047,356.00	0.51
36	601601	中国太保	48,500	2,032,635.00	0.50
37	688012	中微公司	7,453	2,032,582.16	0.50

38	300124	汇川技术	26,725	2,013,194.25	0.50
39	601088	中国神华	48,200	1,952,100.00	0.48
40	603986	兆易创新	8,900	1,906,825.00	0.47
41	002714	牧原股份	37,100	1,876,518.00	0.46
42	000063	中兴通讯	46,700	1,767,128.00	0.44
43	600031	三一重工	83,500	1,764,355.00	0.44
44	600111	北方稀土	37,300	1,720,276.00	0.42
45	603019	中科曙光	20,000	1,712,800.00	0.42
46	002050	三花智控	30,800	1,703,548.00	0.42
47	688008	澜起科技	14,461	1,703,505.80	0.42
48	002230	科大讯飞	33,100	1,664,599.00	0.41
49	601857	中国石油	156,600	1,630,206.00	0.40
50	603501	豪威集团	12,600	1,586,340.00	0.39
51	000001	平安银行	135,100	1,541,491.00	0.38
52	601012	隆基绿能	84,400	1,536,080.00	0.38
53	600089	特变电工	69,000	1,533,180.00	0.38
54	002415	海康威视	51,200	1,527,808.00	0.38
55	000425	徐工机械	131,700	1,525,086.00	0.38
56	600660	福耀玻璃	23,200	1,502,664.00	0.37
57	300760	迈瑞医疗	7,700	1,466,465.00	0.36
58	601668	中国建筑	283,900	1,456,407.00	0.36
59	601127	赛力斯	12,000	1,451,520.00	0.36
60	002384	东山精密	16,900	1,430,585.00	0.35
61	601888	中国中免	14,900	1,408,944.00	0.35
62	603799	华友钴业	20,251	1,382,333.26	0.34
63	601919	中远海控	91,000	1,381,380.00	0.34
64	600941	中国移动	13,561	1,370,339.05	0.34
65	600690	海尔智家	52,344	1,365,654.96	0.34
66	601600	中国铝业	110,100	1,345,422.00	0.33
67	002352	顺丰控股	35,000	1,341,200.00	0.33
68	601728	中国电信	212,800	1,340,640.00	0.33
69	000338	潍柴动力	77,800	1,338,160.00	0.33
70	000100	TCL 科技	294,100	1,335,214.00	0.33
71	002463	沪电股份	18,100	1,322,567.00	0.33
72	600406	国电南瑞	58,282	1,310,179.36	0.32
73	600028	中国石化	208,300	1,287,294.00	0.32
74	600418	江淮汽车	26,000	1,287,000.00	0.32
75	000792	盐湖股份	44,750	1,260,160.00	0.31
76	002028	思源电气	8,000	1,236,720.00	0.31
77	000988	华工科技	15,500	1,229,615.00	0.30
78	300033	同花顺	3,800	1,224,284.00	0.30
79	688111	金山办公	3,909	1,200,336.63	0.30
80	601225	陕西煤业	55,800	1,189,656.00	0.29
81	601766	中国中车	172,700	1,177,814.00	0.29

82	000568	泸州老窖	10,100	1,173,822.00	0.29
83	601988	中国银行	201,900	1,156,887.00	0.29
84	600050	中国联通	223,700	1,143,107.00	0.28
85	601628	中国人寿	24,500	1,114,750.00	0.28
86	600183	生益科技	15,500	1,106,855.00	0.27
87	300394	天孚通信	5,400	1,096,362.00	0.27
88	002916	深南电路	4,710	1,094,085.90	0.27
89	688271	联影医疗	8,589	1,077,919.50	0.27
90	000977	浪潮信息	15,900	1,058,940.00	0.26
91	600547	山东黄金	27,200	1,052,912.00	0.26
92	002027	分众传媒	142,600	1,050,962.00	0.26
93	600938	中国海油	34,600	1,044,228.00	0.26
94	300014	亿纬锂能	15,800	1,039,008.00	0.26
95	002625	光启技术	21,100	1,028,836.00	0.25
96	002241	歌尔股份	35,600	1,022,788.00	0.25
97	600104	上汽集团	66,500	1,012,130.00	0.25
98	002460	赣锋锂业	16,000	1,006,240.00	0.25
99	601689	拓普集团	12,900	995,622.00	0.25
100	605499	东鹏饮料	3,700	989,343.00	0.24
101	601985	中国核电	114,119	987,129.35	0.24
102	000408	藏格矿业	11,400	962,160.00	0.24
103	600489	中金黄金	39,600	925,056.00	0.23
104	000807	云铝股份	28,000	919,520.00	0.23
105	300136	信维通信	14,700	911,400.00	0.23
106	603288	海天味业	24,500	906,990.00	0.22
107	688072	拓荆科技	2,745	905,850.00	0.22
108	600436	片仔癀	5,300	894,534.00	0.22
109	600019	宝钢股份	120,000	894,000.00	0.22
110	600362	江西铜业	16,200	889,704.00	0.22
111	002466	天齐锂业	16,000	886,080.00	0.22
112	601006	大秦铁路	169,797	876,152.52	0.22
113	300450	先导智能	17,100	854,658.00	0.21
114	688521	芯原股份	6,192	848,118.24	0.21
115	601658	邮储银行	153,800	838,210.00	0.21
116	002709	天赐材料	17,861	827,500.13	0.20
117	300408	三环集团	18,038	825,238.50	0.20
118	002049	紫光国微	10,455	823,958.55	0.20
119	000625	长安汽车	68,500	812,410.00	0.20
120	002837	英维克	7,600	812,364.00	0.20
121	300433	蓝思科技	26,700	808,209.00	0.20
122	600905	三峡能源	197,400	807,366.00	0.20
123	600879	航天电子	37,200	793,104.00	0.20
124	600580	卧龙电驱	16,100	790,510.00	0.20
125	601727	上海电气	91,300	786,093.00	0.19

126	002558	巨人网络	18,100	783,549.00	0.19
127	002738	中矿资源	9,900	777,645.00	0.19
128	601390	中国中铁	142,400	770,384.00	0.19
129	600585	海螺水泥	34,900	762,914.00	0.19
130	600988	赤峰黄金	24,400	762,256.00	0.19
131	000538	云南白药	13,380	759,448.80	0.19
132	600010	包钢股份	318,500	758,030.00	0.19
133	600438	通威股份	36,400	746,928.00	0.18
134	600115	中国东航	123,300	739,800.00	0.18
135	300015	爱尔眼科	67,044	736,143.12	0.18
136	601100	恒立液压	6,600	725,406.00	0.18
137	600584	长电科技	19,500	717,210.00	0.18
138	600893	航发动力	17,900	716,537.00	0.18
139	688120	华海清科	4,672	701,173.76	0.17
140	600160	巨化股份	18,200	699,244.00	0.17
141	000426	兴业银锡	19,600	697,760.00	0.17
142	600118	中国卫星	7,300	693,135.00	0.17
143	688002	睿创微纳	6,756	681,004.80	0.17
144	600760	中航沈飞	12,100	679,415.00	0.17
145	601168	西部矿业	24,400	674,416.00	0.17
146	600522	中天科技	37,200	674,064.00	0.17
147	002074	国轩高科	16,900	660,959.00	0.16
148	000630	铜陵有色	108,900	654,489.00	0.16
149	000938	紫光股份	26,576	653,769.60	0.16
150	600487	亨通光电	26,300	650,399.00	0.16
151	002920	德赛西威	5,400	649,620.00	0.16
152	600570	恒生电子	21,400	645,210.00	0.16
153	600346	恒力石化	28,500	642,105.00	0.16
154	600426	华鲁恒升	20,400	641,172.00	0.16
155	688122	西部超导	8,544	637,211.52	0.16
156	000933	神火股份	22,700	623,569.00	0.15
157	600795	国电电力	122,800	618,912.00	0.15
158	600029	南方航空	77,050	617,170.50	0.15
159	601669	中国电建	117,700	612,040.00	0.15
160	002532	天山铝业	37,700	609,986.00	0.15
161	600048	保利发展	99,600	607,560.00	0.15
162	300442	润泽科技	11,500	607,200.00	0.15
163	600176	中国巨石	35,100	600,210.00	0.15
164	600549	厦门钨业	14,600	599,476.00	0.15
165	601058	赛轮轮胎	37,000	598,660.00	0.15
166	600415	小商品城	37,300	594,935.00	0.15
167	000975	山金国际	24,400	593,652.00	0.15
168	002202	金风科技	29,000	591,600.00	0.15
169	002179	中航光电	16,674	590,926.56	0.15

170	600989	宝丰能源	30,000	588,900.00	0.15
171	002156	通富微电	15,578	587,290.60	0.15
172	688777	中控技术	11,901	587,195.34	0.15
173	688169	石头科技	3,844	584,518.64	0.14
174	000157	中联重科	67,300	580,799.00	0.14
175	002340	格林美	69,300	579,348.00	0.14
176	600066	宇通客车	17,700	578,790.00	0.14
177	300339	润和软件	11,600	574,200.00	0.14
178	002195	岩山科技	79,400	562,946.00	0.14
179	600096	云天化	16,800	561,288.00	0.14
180	002353	杰瑞股份	7,900	559,557.00	0.14
181	600143	金发科技	28,600	558,844.00	0.14
182	603129	春风动力	2,000	557,360.00	0.14
183	300751	迈为股份	2,700	556,173.00	0.14
184	002001	新和成	22,020	554,683.80	0.14
185	688036	传音控股	8,364	553,362.24	0.14
186	002517	恺英网络	25,300	553,311.00	0.14
187	300454	深信服	4,800	552,768.00	0.14
188	300418	昆仑万维	13,100	546,270.00	0.13
189	688099	晶晨股份	6,262	546,234.26	0.13
190	600219	南山铝业	99,800	536,924.00	0.13
191	300058	蓝色光标	46,440	534,988.80	0.13
192	600009	上海机场	16,200	530,712.00	0.13
193	601360	三六零	47,300	528,341.00	0.13
194	002436	兴森科技	24,900	527,133.00	0.13
195	002131	利欧股份	93,200	525,648.00	0.13
196	002555	三七互娱	22,200	523,920.00	0.13
197	300207	欣旺达	20,000	523,000.00	0.13
198	688396	华润微	9,867	521,569.62	0.13
199	002456	欧菲光	48,900	519,318.00	0.13
200	000547	航天发展	15,700	518,257.00	0.13
201	000963	华东医药	13,100	516,795.00	0.13
202	688235	百济神州	1,920	515,712.00	0.13
203	688126	沪硅产业	23,677	512,370.28	0.13
204	002008	大族激光	12,400	510,756.00	0.13
205	300803	指南针	3,900	510,393.00	0.13
206	688213	思特威	5,304	504,357.36	0.12
207	002493	荣盛石化	42,900	502,359.00	0.12
208	002422	科伦药业	17,100	501,885.00	0.12
209	002236	大华股份	26,400	500,016.00	0.12
210	300724	捷佳伟创	5,200	497,120.00	0.12
211	300604	长川科技	4,900	496,419.00	0.12
212	601186	中国铁建	64,577	495,305.59	0.12
213	600895	张江高科	11,100	487,290.00	0.12

214	002601	龙佰集团	24,800	485,584.00	0.12
215	688506	百利天恒	1,500	484,650.00	0.12
216	002407	多氟多	14,200	481,522.00	0.12
217	600745	闻泰科技	12,900	480,912.00	0.12
218	601111	中国国航	51,000	477,870.00	0.12
219	600157	永泰能源	304,000	477,280.00	0.12
220	000768	中航西飞	18,700	474,606.00	0.12
221	601877	正泰电器	17,000	474,130.00	0.12
222	002938	鹏鼎控股	9,365	473,681.70	0.12
223	600699	均胜电子	15,100	473,536.00	0.12
224	600372	中航机载	35,200	472,384.00	0.12
225	002273	水晶光电	18,700	469,744.00	0.12
226	600673	东阳光	20,900	468,787.00	0.12
227	002851	麦格米特	5,200	468,364.00	0.12
228	002252	上海莱士	73,400	465,356.00	0.11
229	000831	中国稀土	10,000	464,400.00	0.11
230	002128	电投能源	16,500	460,515.00	0.11
231	600886	国投电力	35,060	459,987.20	0.11
232	603659	璞泰来	16,800	459,312.00	0.11
233	688608	恒玄科技	2,022	458,872.68	0.11
234	600839	四川长虹	50,300	457,730.00	0.11
235	300866	安克创新	4,000	457,560.00	0.11
236	600741	华域汽车	22,800	456,000.00	0.11
237	300395	菲利华	4,500	451,350.00	0.11
238	300757	罗博特科	1,900	443,270.00	0.11
239	600196	复星医药	16,700	442,383.00	0.11
240	688578	艾力斯	4,245	442,116.75	0.11
241	002648	卫星化学	25,000	442,000.00	0.11
242	600011	华能国际	59,200	441,632.00	0.11
243	600885	宏发股份	14,490	440,496.00	0.11
244	600515	海南机场	82,600	440,258.00	0.11
245	302132	中航成飞	5,500	434,500.00	0.11
246	601868	中国能建	183,900	432,165.00	0.11
247	002472	双环传动	9,100	431,431.00	0.11
248	601233	桐昆股份	25,000	430,250.00	0.11
249	601872	招商轮船	47,300	424,754.00	0.10
250	003816	中国广核	112,800	424,128.00	0.10
251	000960	锡业股份	15,100	420,988.00	0.10
252	600233	圆通速递	25,600	420,352.00	0.10
253	002138	顺络电子	11,800	419,254.00	0.10
254	002185	华天科技	37,900	415,763.00	0.10
255	601319	中国人保	46,400	415,280.00	0.10
256	600460	士兰微	14,600	414,786.00	0.10
257	001979	招商蛇口	48,000	414,720.00	0.10

258	688017	绿的谐波	2,157	414,359.70	0.10
259	600352	浙江龙盛	38,800	413,608.00	0.10
260	002465	海格通信	26,200	412,650.00	0.10
261	300896	爱美客	2,900	410,988.00	0.10
262	600392	盛和资源	18,900	406,917.00	0.10
263	002129	TCL 中环	47,400	406,218.00	0.10
264	000301	东方盛虹	37,200	405,108.00	0.10
265	002812	恩捷股份	7,100	402,144.00	0.10
266	300346	南大光电	9,320	399,828.00	0.10
267	601800	中国交建	48,400	398,816.00	0.10
268	002281	光迅科技	5,700	398,715.00	0.10
269	601615	明阳智能	27,300	395,304.00	0.10
270	002409	雅克科技	5,300	392,730.00	0.10
271	002078	太阳纸业	24,900	392,175.00	0.10
272	688047	龙芯中科	2,968	392,102.48	0.10
273	300054	鼎龙股份	10,400	391,040.00	0.10
274	600141	兴发集团	11,300	390,754.00	0.10
275	000786	北新建材	15,600	389,532.00	0.10
276	600039	四川路桥	38,800	386,060.00	0.10
277	688617	惠泰医疗	1,583	385,096.41	0.10
278	601117	中国化学	50,200	378,006.00	0.09
279	300759	康龙化成	13,200	375,276.00	0.09
280	300390	天华新能	6,800	371,348.00	0.09
281	002414	高德红外	25,300	371,151.00	0.09
282	000878	云南铜业	18,000	369,180.00	0.09
283	000066	中国长城	25,600	368,896.00	0.09
284	601633	长城汽车	16,200	366,606.00	0.09
285	300017	网宿科技	35,700	365,925.00	0.09
286	600588	用友网络	27,500	364,650.00	0.09
287	002155	湖南黄金	17,200	362,748.00	0.09
288	000617	中油资本	37,500	360,000.00	0.09
289	600674	川投能源	25,600	355,840.00	0.09
290	002595	豪迈科技	4,200	354,942.00	0.09
291	002130	沃尔核材	13,400	352,688.00	0.09
292	300347	泰格医药	6,200	351,540.00	0.09
293	603486	科沃斯	4,300	346,924.00	0.09
294	601021	春秋航空	5,800	345,100.00	0.09
295	002821	凯莱英	3,700	343,841.00	0.08
296	002271	东方雨虹	25,300	343,827.00	0.08
297	688180	君实生物	9,990	341,258.40	0.08
298	300012	华测检测	25,100	340,105.00	0.08
299	300567	精测电子	3,700	337,440.00	0.08
300	002294	信立泰	6,800	336,940.00	0.08
301	301236	软通动力	7,100	336,753.00	0.08

302	301358	湖南裕能	5,200	336,232.00	0.08
303	002497	雅化集团	13,500	334,125.00	0.08
304	600498	烽火通信	10,400	333,632.00	0.08
305	600482	中国动力	16,100	333,270.00	0.08
306	601799	星宇股份	2,700	333,099.00	0.08
307	002085	万丰奥威	20,800	333,008.00	0.08
308	601179	中国西电	36,500	332,150.00	0.08
309	688223	晶科能源	58,598	330,492.72	0.08
310	688005	容百科技	9,318	329,857.20	0.08
311	300223	北京君正	3,100	328,724.00	0.08
312	300251	光线传媒	19,800	324,324.00	0.08
313	000932	华菱钢铁	57,700	324,274.00	0.08
314	300661	圣邦股份	4,720	323,980.80	0.08
315	600497	驰宏锌锗	44,300	323,833.00	0.08
316	002444	巨星科技	9,500	323,190.00	0.08
317	688303	大全能源	12,032	322,698.24	0.08
318	300972	万辰集团	1,600	321,712.00	0.08
319	300763	锦浪科技	4,500	321,345.00	0.08
320	300316	晶盛机电	8,700	319,725.00	0.08
321	300037	新宙邦	6,100	319,640.00	0.08
322	600486	扬农化工	4,600	319,194.00	0.08
323	300285	国瓷材料	11,600	317,956.00	0.08
324	600256	广汇能源	64,500	317,340.00	0.08
325	300748	金力永磁	9,300	317,223.00	0.08
326	688266	泽璟制药	3,408	315,921.60	0.08
327	002405	四维图新	34,700	312,647.00	0.08
328	002180	纳思达	15,300	309,366.00	0.08
329	603605	珀莱雅	4,500	308,160.00	0.08
330	002410	广联达	24,300	305,694.00	0.08
331	300782	卓胜微	3,731	304,001.88	0.08
332	688472	阿特斯	20,387	303,970.17	0.08
333	605117	德业股份	3,520	303,424.00	0.07
334	002459	晶澳科技	26,300	301,135.00	0.07
335	300002	神州泰岳	26,000	299,520.00	0.07
336	300024	机器人	16,400	298,316.00	0.07
337	002624	完美世界	18,200	298,298.00	0.07
338	600085	同仁堂	9,200	296,792.00	0.07
339	601618	中国中冶	99,100	294,327.00	0.07
340	600862	中航高科	12,400	293,012.00	0.07
341	600803	新奥股份	14,100	292,716.00	0.07
342	002223	鱼跃医疗	7,600	290,396.00	0.07
343	300699	光威复材	7,344	289,794.24	0.07
344	603979	金诚信	3,800	289,370.00	0.07
345	000683	博源化工	38,700	287,928.00	0.07

346	300474	景嘉微	4,000	287,480.00	0.07
347	300122	智飞生物	15,200	286,824.00	0.07
348	688599	天合光能	17,220	284,991.00	0.07
349	002065	东华软件	31,100	284,565.00	0.07
350	000623	吉林敖东	14,400	281,232.00	0.07
351	600079	ST 人福	15,500	280,705.00	0.07
352	000039	中集集团	27,800	280,502.00	0.07
353	000034	神州数码	7,200	280,152.00	0.07
354	600161	天坛生物	17,100	279,414.00	0.07
355	600026	中远海能	23,900	279,152.00	0.07
356	600765	中航重机	14,500	277,820.00	0.07
357	300073	当升科技	4,800	277,440.00	0.07
358	300003	乐普医疗	17,470	276,200.70	0.07
359	002064	华峰化学	25,000	275,000.00	0.07
360	600563	法拉电子	2,600	272,870.00	0.07
361	000661	长春高新	2,900	268,395.00	0.07
362	000009	中国宝安	27,200	267,920.00	0.07
363	600845	宝信软件	12,900	267,159.00	0.07
364	000887	中鼎股份	11,400	264,594.00	0.07
365	603606	东方电缆	4,400	262,900.00	0.06
366	688188	柏楚电子	1,925	261,588.25	0.06
367	002025	航天电器	5,200	260,676.00	0.06
368	001965	招商公路	25,800	260,064.00	0.06
369	002007	华兰生物	17,142	259,358.46	0.06
370	300568	星源材质	17,000	259,250.00	0.06
371	600177	雅戈尔	33,900	257,640.00	0.06
372	300413	芒果超媒	10,500	256,410.00	0.06
373	002245	蔚蓝锂芯	14,400	256,320.00	0.06
374	600704	物产中大	45,900	255,663.00	0.06
375	300142	沃森生物	23,300	254,203.00	0.06
376	300919	中伟股份	5,480	253,888.40	0.06
377	000708	中信特钢	15,500	253,735.00	0.06
378	300001	特锐德	9,800	251,664.00	0.06
379	000423	东阿阿胶	5,102	250,406.16	0.06
380	600637	东方明珠	25,400	250,190.00	0.06
381	300496	中科创达	3,700	249,750.00	0.06
382	002318	久立特材	8,600	248,970.00	0.06
383	002176	江特电机	25,400	247,396.00	0.06
384	000830	鲁西化工	14,800	245,236.00	0.06
385	605589	圣泉集团	8,600	243,380.00	0.06
386	000738	航发控制	11,400	242,934.00	0.06
387	600332	白云山	9,405	242,084.70	0.06
388	601677	明泰铝业	16,300	241,077.00	0.06
389	600153	建发股份	26,000	240,500.00	0.06

390	000999	华润三九	8,428	239,860.88	0.06
391	002044	美年健康	45,200	238,656.00	0.06
392	601238	广汽集团	29,200	238,272.00	0.06
393	603087	甘李药业	3,500	238,245.00	0.06
394	300627	华测导航	6,800	237,388.00	0.06
395	000415	渤海租赁	58,600	237,330.00	0.06
396	300383	光环新网	18,967	237,277.17	0.06
397	300253	卫宁健康	26,800	236,376.00	0.06
398	603596	伯特利	4,600	235,842.00	0.06
399	600521	华海药业	13,700	232,489.00	0.06
400	000400	许继电气	9,030	232,161.30	0.06
401	600208	衢州发展	59,600	230,652.00	0.06
402	300832	新产业	4,100	230,625.00	0.06
403	688166	博瑞医药	4,685	229,846.10	0.06
404	300573	兴齐眼药	3,240	227,739.60	0.06
405	603806	福斯特	16,180	225,872.80	0.06
406	000519	中兵红箭	12,400	225,804.00	0.06
407	002389	航天彩虹	9,400	225,412.00	0.06
408	300558	贝达药业	4,800	224,112.00	0.06
409	300088	长信科技	36,600	221,796.00	0.05
410	601607	上海医药	12,400	221,464.00	0.05
411	601216	君正集团	45,500	219,310.00	0.05
412	300459	汤姆猫	47,500	218,025.00	0.05
413	300676	华大基因	4,800	217,728.00	0.05
414	603568	伟明环保	8,576	217,658.88	0.05
415	300083	创世纪	23,600	217,356.00	0.05
416	000629	钒钛股份	69,100	214,210.00	0.05
417	002603	以岭药业	12,500	213,375.00	0.05
418	688009	中国通号	38,813	212,307.11	0.05
419	600398	海澜之家	34,700	209,935.00	0.05
420	002152	广电运通	15,200	209,912.00	0.05
421	601018	宁波港	57,800	209,814.00	0.05
422	300068	南都电源	13,500	209,790.00	0.05
423	000733	振华科技	4,000	209,640.00	0.05
424	601567	三星医疗	9,100	209,482.00	0.05
425	600312	平高电气	12,000	208,200.00	0.05
426	688065	凯赛生物	4,154	206,869.20	0.05
427	300628	亿联网络	5,800	206,770.00	0.05
428	603077	和邦生物	91,400	206,564.00	0.05
429	600516	方大炭素	36,000	204,840.00	0.05
430	600018	上港集团	37,700	204,334.00	0.05
431	300118	东方日升	13,800	202,308.00	0.05
432	600170	上海建工	75,900	201,135.00	0.05
433	600166	福田汽车	68,200	199,144.00	0.05

434	603650	彤程新材	4,500	198,630.00	0.05
435	603885	吉祥航空	13,300	197,904.00	0.05
436	600820	隧道股份	29,900	194,051.00	0.05
437	688390	固德威	3,115	193,534.95	0.05
438	600998	九州通	37,500	192,000.00	0.05
439	601155	新城控股	13,700	191,115.00	0.05
440	600499	科达制造	13,500	187,245.00	0.05
441	300144	宋城演艺	22,600	185,094.00	0.05
442	603816	顾家家居	5,900	181,366.00	0.04
443	300438	鹏辉能源	3,400	180,948.00	0.04
444	688063	派能科技	3,181	180,744.42	0.04
445	603260	合盛硅业	3,400	179,180.00	0.04
446	002841	视源股份	4,500	178,335.00	0.04
447	600008	首创环保	59,375	178,125.00	0.04
448	002607	中公教育	64,900	177,826.00	0.04
449	603833	欧派家居	3,400	177,106.00	0.04
450	600859	王府井	11,300	175,489.00	0.04
451	002739	万达电影	15,500	175,460.00	0.04
452	002145	钛能化学	35,300	172,970.00	0.04
453	603392	万泰生物	3,800	170,772.00	0.04
454	002312	川发龙蟒	15,400	168,322.00	0.04
455	600316	洪都航空	4,756	166,031.96	0.04
456	600529	山东药玻	8,300	165,419.00	0.04
457	600667	太极实业	20,400	162,588.00	0.04
458	600535	天士力	10,600	159,742.00	0.04
459	601880	辽港股份	99,100	158,560.00	0.04
460	603939	益丰药房	7,300	158,556.00	0.04
461	002266	浙富控股	37,900	157,664.00	0.04
462	600038	中直股份	4,358	157,454.54	0.04
463	002701	奥瑞金	25,700	152,915.00	0.04
464	002244	滨江集团	15,114	151,895.70	0.04
465	600323	瀚蓝环境	5,300	151,580.00	0.04
466	601000	唐山港	39,000	149,760.00	0.04
467	000035	中国天楹	26,800	147,936.00	0.04
468	601866	中远海发	58,700	147,924.00	0.04
469	002756	永兴材料	2,700	146,475.00	0.04
470	000069	华侨城 A	58,900	146,072.00	0.04
471	600258	首旅酒店	8,400	140,700.00	0.03
472	601966	玲珑轮胎	9,500	138,035.00	0.03
473	002091	江苏国泰	15,000	135,450.00	0.03
474	002544	普天科技	3,900	134,511.00	0.03
475	600004	白云机场	14,000	132,440.00	0.03
476	000998	隆平高科	14,100	131,976.00	0.03
477	002120	韵达股份	19,000	128,060.00	0.03

478	600754	锦江酒店	5,000	126,350.00	0.03
479	600325	华发股份	29,900	126,178.00	0.03
480	300601	康泰生物	8,500	125,545.00	0.03
481	600655	豫园股份	24,200	124,146.00	0.03
482	002432	九安医疗	3,000	120,120.00	0.03
483	002292	奥飞娱乐	13,200	116,820.00	0.03
484	600867	通化东宝	14,000	114,380.00	0.03
485	000818	航锦科技	5,900	113,870.00	0.03
486	000967	盈峰环境	15,500	113,770.00	0.03
487	300457	赢合科技	4,000	111,400.00	0.03
488	300070	碧水源	28,000	109,760.00	0.03
489	600763	通策医疗	2,700	108,567.00	0.03
490	600864	哈投股份	15,000	99,450.00	0.02
491	300529	健帆生物	5,000	98,350.00	0.02
492	600816	建元信托	34,600	97,918.00	0.02
493	600511	国药股份	3,400	97,750.00	0.02
494	002572	索菲亚	6,800	92,548.00	0.02
495	000032	深桑达 A	4,600	89,010.00	0.02
496	002891	中宠股份	1,700	87,992.00	0.02
497	603899	晨光股份	3,100	83,886.00	0.02
498	600007	中国国贸	3,800	75,316.00	0.02
499	001914	招商积余	4,100	43,788.00	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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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	91,474,979.80	22.59
2	300750	宁德时代	85,188,033.60	21.04
3	601318	中国平安	47,391,600.90	11.71
4	600036	招商银行	43,843,622.83	10.83
5	000333	美的集团	41,817,805.80	10.33
6	300059	东方财富	33,582,873.68	8.29
7	002371	北方华创	32,289,335.92	7.98
8	002594	比亚迪	32,206,481.54	7.95
9	000858	五粮液	31,198,240.00	7.71

10	600900	长江电力	29,777,012.00	7.35
11	601166	兴业银行	27,590,065.50	6.81
12	002475	立讯精密	24,266,604.25	5.99
13	601899	紫金矿业	23,774,162.00	5.87
14	600030	中信证券	23,719,530.30	5.86
15	000651	格力电器	21,426,375.00	5.29
16	601398	工商银行	20,415,628.00	5.04
17	300760	迈瑞医疗	20,052,855.00	4.95
18	688981	中芯国际	19,059,509.14	4.71
19	688041	海光信息	18,249,893.77	4.51
20	000725	京东方 A	18,035,318.00	4.45
21	600276	恒瑞医药	17,417,846.40	4.30
22	300124	汇川技术	17,235,989.75	4.26
23	601328	交通银行	15,572,304.00	3.85
24	600887	伊利股份	14,712,773.02	3.63
25	000063	中兴通讯	14,274,854.00	3.53
26	601816	京沪高铁	14,264,165.75	3.52
27	601288	农业银行	14,074,238.00	3.48
28	600309	万华化学	13,103,352.00	3.24
29	002415	海康威视	12,569,159.00	3.10
30	600919	江苏银行	12,413,834.00	3.07
31	603259	药明康德	12,327,643.00	3.04
32	300308	中际旭创	12,222,244.00	3.02
33	002714	牧原股份	12,188,873.82	3.01
34	000001	平安银行	12,173,421.00	3.01
35	300274	阳光电源	11,866,448.20	2.93
36	688256	寒武纪	11,228,989.10	2.77
37	002230	科大讯飞	11,020,354.80	2.72
38	600000	浦发银行	10,948,089.00	2.70
39	601088	中国神华	10,801,156.00	2.67
40	002352	顺丰控股	10,537,679.00	2.60
41	000100	TCL 科技	10,434,935.00	2.58
42	601601	中国太保	10,349,627.00	2.56
43	601668	中国建筑	9,960,607.00	2.46
44	601728	中国电信	9,834,667.00	2.43
45	603019	中科曙光	9,674,978.00	2.39
46	000568	泸州老窖	9,621,703.43	2.38
47	601988	中国银行	9,559,045.00	2.36
48	688008	澜起科技	9,513,883.95	2.35
49	300502	新易盛	8,911,313.00	2.20
50	601127	赛力斯	8,802,531.00	2.17
51	603986	兆易创新	8,700,832.61	2.15
52	600690	海尔智家	8,682,598.96	2.14
53	600031	三一重工	8,603,686.00	2.13

54	000338	潍柴动力	8,497,926.00	2.10
55	603501	豪威集团	8,464,834.30	2.09
56	601012	隆基绿能	8,291,772.04	2.05
57	600941	中国移动	8,275,108.17	2.04
58	002050	三花智控	8,267,115.00	2.04
59	600150	中国船舶	8,185,612.08	2.02

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	300750	宁德时代	77,096,381.20	19.04
2	000333	美的集团	36,400,582.00	8.99
3	002371	北方华创	31,868,066.80	7.87
4	300059	东方财富	29,062,660.53	7.18
5	002594	比亚迪	28,522,548.04	7.05
6	000858	五粮液	27,768,127.00	6.86
7	002475	立讯精密	20,805,933.36	5.14
8	000651	格力电器	18,859,342.00	4.66
9	300760	迈瑞医疗	17,639,506.00	4.36
10	300124	汇川技术	15,115,610.00	3.73
11	000725	京东方 A	15,036,117.00	3.71
12	300308	中际旭创	13,618,049.40	3.36
13	300502	新易盛	12,603,843.00	3.11
14	688256	寒武纪	12,043,768.58	2.97
15	002714	牧原股份	11,828,888.00	2.92
16	000063	中兴通讯	11,522,027.00	2.85
17	300274	阳光电源	11,088,610.90	2.74
18	002415	海康威视	10,848,233.00	2.68
19	000001	平安银行	10,837,736.00	2.68
20	002352	顺丰控股	9,506,346.00	2.35
21	002230	科大讯飞	8,869,572.98	2.19
22	000568	泸州老窖	8,781,420.00	2.17
23	000100	TCL 科技	8,436,303.00	2.08

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

买入股票的成本（成交）总额	2,380,515,448.21
卖出股票的收入（成交）总额	1,175,539,982.17

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的。本基金管理人将充分考虑股指期货的流动性及风险收益特征，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行多头或空头套期保值等策略操作。法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

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

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。国债期货相关投资严格遵循法律法规及中国证监会的规定。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

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中，招商银行股份有限公司在本报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚，兴业银行股份有限公司在本报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司制度的规定。

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

8.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定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	92,012.70
2	应收清算款	1,815,718.66
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,907,731.36

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

本基金本报告期末前五名积极投资中不存在流通受限情况。

§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

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
327	990,349.54	303,896,800.00	93.84%	19,947,500.00	6.16%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国平安人寿保险股份有限公司-分红-个险分红	99,581,800.00	30.75%
2	中国人寿保险股份有限公司	53,295,447.00	16.46%
3	中国平安人寿保险股份有限公司-万能-个险万能	15,481,700.00	4.78%
4	华泰证券股份有限公司	15,000,089.00	4.63%
5	方正证券股份有限公司	12,973,700.00	4.01%
6	海富通基金管理有限公司	10,000,000.00	3.09%
7	国泰海通证券股份有限公司	8,431,938.00	2.60%
8	广发证券股份有限公司	7,223,734.00	2.23%
9	上海惠澄资产管理有限公司-惠澄仲春五号私募证券投资基金	6,000,000.00	1.85%
10	中国移动通信集团有限公司企业年金计划-中国工商银行股份有限公司	4,655,900.00	1.44%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	62,800.00	0.0194%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2025年1月22日)基金份额总额	1,937,844,300.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	531,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	2,145,000,000.00
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	323,844,300.00

§11 重大事件揭示**11.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：

2025年4月23日，海富通基金管理有限公司发布公告，谢乐斌先生自2025年4月21日起担任公司董事长，路颖女士因工作调整不再担任公司董事长。

基金托管人：

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，无涉及本基金基金管理人基金管理业务、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发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来聘请毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务。本年度应支付的审计费用是 45,000.00 元，目前事务所已提供审计服务的连续年限是 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	海富通基金管理有限公司
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 8 月 19 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)	已完成有关整改工作。
其他	-

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人无受调查或处罚等情况。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	2	2,076,840,440.59	58.45%	386,091.10	58.45%	-
中信证券	1	1,217,280,312.37	34.26%	226,302.39	34.26%	-
华泰证券	2	145,554,148.21	4.10%	27,057.61	4.10%	-
国泰海通证券	2	113,229,524.17	3.19%	21,049.65	3.19%	-

注：1、报告期内本基金新增华泰证券 2 个交易单元。上述租用海通证券进行交易时间区间为 2025 年 1 月 22 日至 2025 年 3 月 14 日，租用国泰海通证券交易单元进行交易时间区间为 2025 年 3 月 15 日至 2025 年 12 月 31 日。

2、交易单元的选择标准：

基金管理人选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司，租用其交易单元供本基金证券交易。

3、交易单元的选择程序：

(1) 由牵头部门依据上述交易单元选择标准及公司内控制度要求，对候选券商开展尽职调查，综合评估其财务状况、经营行为、合规风控能力、交易、研究等服务能力。

(2) 经评估，牵头部门将符合公司制度要求的券商相关材料提交督察长进行合规性审查，再提交基金管理人的总经理办公会审议。

(3) 基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》。

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		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期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
海通证券	600,051.00	100.00%	1,255,700,000.00	99.21%	-	-

中信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	10,000,000.00	0.79%	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-

注：上述租用海通证券交易单元进行交易时间区间为 2025 年 1 月 22 日至 2025 年 3 月 14 日，租用国泰海通证券交易单元进行交易时间区间为 2025 年 3 月 15 日至 2025 年 12 月 31 日。

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	海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-01-06
2	海富通基金管理有限公司关于变更主要股东及实际控制人事项获得中国证券监督管理委员会批复的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-01-21
3	海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-01-23
4	海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-02-07
5	海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-02-07
6	关于海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金调整最小申购、赎回单位的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-02-08
7	海富通基金管理有限公司关于新增部分券商为海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金一级交易商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-02-12
8	海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-02-12

		网站	
9	海富通基金管理有限公司关于新增部分券商为海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金一级交易商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-02-19
10	海富通基金管理有限公司关于新增部分券商为海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金一级交易商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-02-26
11	海富通基金管理有限公司关于新增国投证券股份有限公司为海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金一级交易商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-14
12	海富通基金管理有限公司关于公司主要股东和实际控制人变更的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-18
13	海富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(2024 年下半年度)	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-31
14	海富通基金管理有限公司关于新增中银国际证券股份有限公司为旗下部分交易型开放式指数证券投资基金一级交易商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-04-09
15	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增江海证券有限公司为申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-04-14
16	海富通基金管理有限公司关于董事长变更的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-04-23
17	海富通基金管理有限公司关于增聘基金经理助理的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-05-08
18	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增民生证券股份有限公司为申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-05-15
19	海富通基金管理有限公司关于海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金新增华西证券股份有限公司为申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-06-06

20	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增西部证券股份有限公司为申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-06-17
21	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东方证券股份有限公司为申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-07-19
22	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东方财富证券股份有限公司为申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-08-27
23	海富通基金管理有限公司关于海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金新增甬兴证券有限公司为申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-09-11
24	海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-10-24
25	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华福证券有限责任公司为申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-11-07
26	海富通基金管理有限公司关于海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金新增华宝证券股份有限公司为申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-11-15
27	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国新证券股份有限公司为申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-11-15
28	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华鑫证券有限责任公司为申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-11-15
29	海富通基金管理有限公司关于旗下上交所 ETF 申购赎回清单版本更新的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-12-08
30	海富通基金管理有限公司关于海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金新增瑞银证券有限责任公司为申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-12-11
31	海富通基金管理有限公司关于调整旗下	中国证券报、基金管	2025-12-26

部分公募基金风险等级的公告	理人网站及中国证监会基金电子披露网站
---------------	--------------------

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	2025/9/1-2025/12/31	-	99,581,800.00	-	99,581,800.00	30.75%
	2	2025/1/22-2025/2/11	400,000.00	400,163,900.00	800,000.00	163,900.00	0.05%
	3	2025/9/1-2025/12/28	-	99,601,600.00	99,601,600.00	-	-

产品特有风险

报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：

- 1、当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险；
- 2、若某单一基金份额持有人巨额赎回有可能引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额；
- 3、若个别投资者大额赎回后，可能会导致基金资产净值连续出现六十个工作日低于5000万元的风险，基金可能会面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；
- 4、其他可能的风险。

注：1、本基金合同生效日为2025年1月22日，期初份额指基金合同生效日持有份额。

2、报告期内单一投资者申购赎回份额包含二级市场交易数据。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

海富通基金管理有限公司成立于2003年4月，是中国首批获准成立的中外合资基金管理公司。

从2003年8月开始，海富通先后募集成立了134只公募基金。截至2025年12月

31 日，海富通管理的公募基金资产规模约 2566 亿元人民币。

海富通是国家人力资源和社会保障部首批企业年金基金投资管理人，是首批获得特定客户资产管理业务资格的基金管理公司。2010 年 12 月，海富通被全国社会保障基金理事会选聘为境内委托投资管理人。2012 年 9 月，中国保监会公告确认海富通为首批保险资金投资管理人之一。2014 年 8 月，海富通全资子公司上海富诚海富通资产管理有限公司正式开业，获准开展特定客户资产管理服务。2016 年 12 月，海富通被全国社会保障基金理事会选聘为首批基本养老保险基金投资管理人。

2022 年 7 月，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获《证券时报》颁发的“五年持续回报灵活配置混合型明星基金奖”。2022 年 8 月，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获《中国证券报》颁发的“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获“三年期开放式混合型持续优胜金牛基金”。2022 年 11 月，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获《上海证券报》颁发的“金基金·灵活配置型基金三年期奖”，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“金基金·偏股混合型基金五年期奖”。

2023 年 6 月，海富通收益增长证券投资基金荣获《证券时报》颁发的“五年持续回报灵活配置型明星基金奖”。2023 年 8 月，海富通荣获《上海证券报》颁发的“上证·中国基金投教创新案例奖”。

2024 年 12 月，海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金荣获《中国证券报》颁发的“债券型 ETF 典型精品案例”。

2025 年 12 月，海富通国策导向混合型证券投资基金荣获《中国证券报》颁发的“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (一)中国证监会批准设立海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金的文件
- (二)海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- (三)海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书
- (四)海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- (五)中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件

(六)法律法规及中国证监会规定的其他文件

13.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 18 层 1802-1803 室以及 19 层 1901-1908 室

13.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司
二〇二六年三月三十一日