

中银证券中证 500 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：中银国际证券股份有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告期自 2025 年 1 月 1 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
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	5
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	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
3.4 过去三年基金的利润分配情况	8
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	14
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
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	15
§ 6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§ 7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 净资产变动表	19
7.4 报表附注	21

§ 8 投资组合报告	49
8.1 期末基金资产组合情况	49
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	50
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	51
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	67
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	67
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	67
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	67
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	67
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	67
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	68
8.12 投资组合报告附注	68
§ 9 基金份额持有人信息	69
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	69
9.2 期末上市基金前十名持有人	69
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	70
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情况	70
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	70
§ 10 开放式基金份额变动	70
§ 11 重大事件揭示	71
11.1 基金份额持有人大会决议	71
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	71
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	71
11.4 基金投资策略的改变	71
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	71
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	71
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	72
11.8 其他重大事件	73
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	75
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	75
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	76
§ 13 备查文件目录	76
13.1 备查文件目录	76
13.2 存放地点	76
13.3 查阅方式	76

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	中银证券中证 500ETF
场内简称	BOCI500 扩位简称：中银证券 500ETF
基金主代码	515190
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 4 月 30 日
基金管理人	中银国际证券股份有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	525,466,080.00 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	2020 年 5 月 27 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。 当预期指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将通过投资非成份股、成份股个股衍生品等方式进行替代，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为交易型开放式指数基金，采用完全复制法跟踪标的指数表现，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		中银国际证券股份有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	盖文国	张姗
	联系电话	021-20328000	400-61-95555
	电子邮箱	gmkf@bocichina.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		956026, 400-620-8888	400-61-95555
传真		021-50372474	0755-83195201

注册地址	上海市浦东新区银城中路 200 号 中银大厦 39F	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	上海市浦东新区银城中路 200 号 中银大厦 39F	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	200120	518040
法定代表人	周权	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.bocifunds.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及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）	中国北京东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 楼
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	2024 年	2023 年
本期已实现收益	14,791,896.99	-2,470,204.41	-1,300,180.24
本期利润	53,057,112.94	6,705,813.74	-4,008,484.29
加权平均基金份额本期利润	0.3354	0.1058	-0.0777
本期加权平均净值利润率	23.81%	9.74%	-6.46%
本期基金份额净值增长率	31.88%	6.81%	-6.62%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末	2024 年末	2023 年末
期末可供分配利润	291,465,197.68	13,504,369.16	5,751,030.72
期末可供分配基金份额利润	0.5547	0.1789	0.1037
期末基金资	816,931,277.68	88,970,449.16	61,217,110.72

产净值			
期末基金份额净值	1.5547	1.1789	1.1037
3.1.3 累计期末指标	2025 年末	2024 年末	2023 年末
基金份额累计净值增长率	55.47%	17.89%	10.37%

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、期末可供分配利润是指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。

3.2 基金净值表现

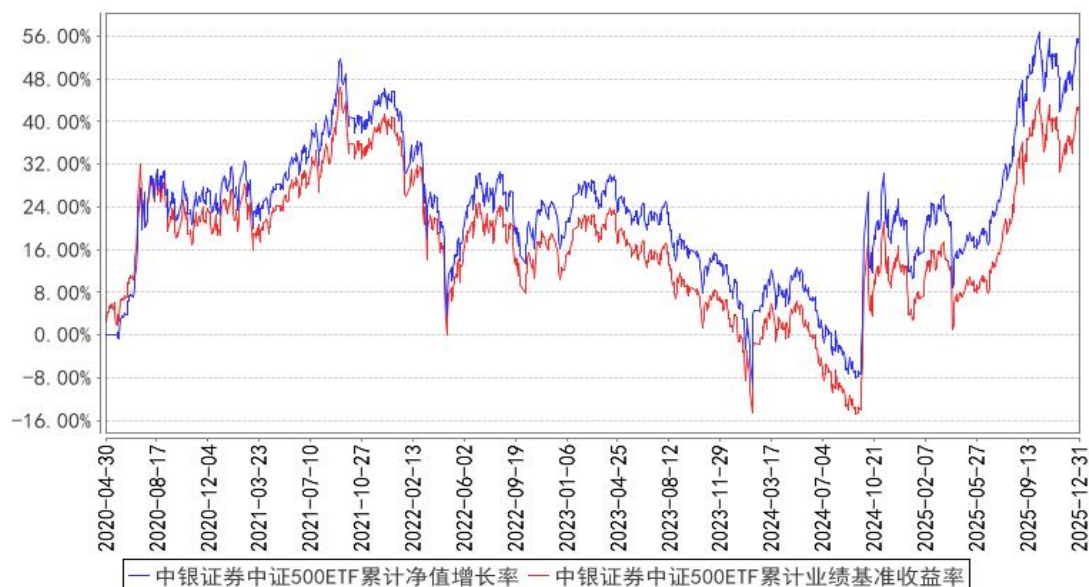
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	1.02%	1.23%	0.72%	1.24%	0.30%	-0.01%
过去六个月	26.72%	1.17%	26.21%	1.17%	0.51%	0.00%
过去一年	31.88%	1.26%	30.39%	1.26%	1.49%	0.00%
过去三年	31.54%	1.35%	27.30%	1.37%	4.24%	-0.02%
过去五年	23.55%	1.29%	17.25%	1.30%	6.30%	-0.01%
自基金合同生效起至今	55.47%	1.28%	42.83%	1.31%	12.64%	-0.03%

注：业绩比较基准=中证 500 指数收益率。

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

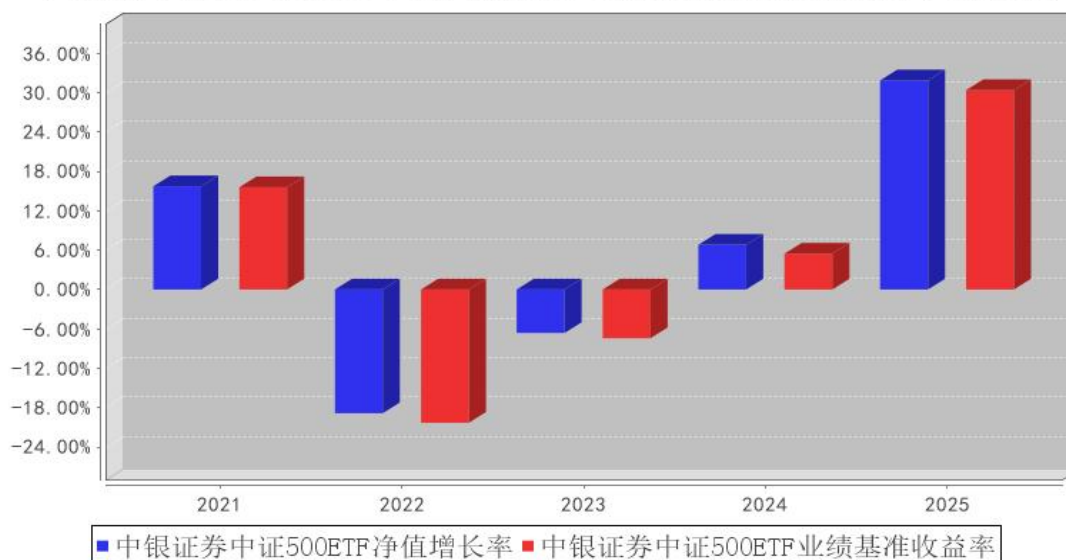
中银证券中证**500ETF**累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同于 2020 年 4 月 30 日生效。

3.2.3 过去五年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

中银证券中证**500ETF**基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

注：无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金未实施利润分配。

§ 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

中银国际证券股份有限公司(以下简称“中银证券”)经中国证监会批准于 2002 年 2 月 28 日在上海成立,注册资本 27.78 亿元人民币。截至 2025 年 9 月 30 日,前十名股东包括中银国际控股有限公司、中国石油集团资本有限责任公司、江西铜业股份有限公司、江苏洋河酒厂股份有限公司、香港中央结算有限公司、中国建设银行股份有限公司—国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、中国通用技术(集团)控股有限责任公司、中国建设银行股份有限公司—华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、中国农业银行股份有限公司—中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、朱晔。中银证券的经营经营范围包括:证券经纪;证券投资咨询;与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问;证券承销与保荐;证券自营;证券资产管理;证券投资基金代销;融资融券;代销金融产品;公开募集证券投资基金管理业务;为期货公司提供中间介绍业务。

截至 2025 年 12 月 31 日,本管理人共管理 44 只证券投资基金,包括:中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金(原中银证券保本 1 号混合型证券投资基金)、中银证券健康产业灵活配置混合型证券投资基金、中银证券现金管家货币市场基金、中银证券安进债券型证券投资基金、中银证券安弘债券型证券投资基金、中银证券汇宇定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券聚瑞混合型证券投资基金、中银证券汇嘉定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券安誉债券型证券投资基金、中银证券汇享定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券新能源灵活配置混合型证券投资基金、中银证券安源债券型证券投资基金、中银证券中高等级债券型证券投资基金、中银证券安泽债券型证券投资基金、中银证券科技创新混合型证券投资基金(LOF)、中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、中银证券安沛债券型证券投资基金、中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中银证券汇远一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券汇兴一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券优选行业龙头混合型证券投资基金、中银证券安汇三年定期开放债券型证券投资基金、中银证券创业板交易型开放式指数证券投资基金、中银证券鑫瑞 6 个月持有期混合型证券投资基金、中银证券精选行业股票型证券投资基金、中银证券汇福一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券盈瑞混合型证券投资基金、中银证券优势制造股票型证券投资基金、中银证券安灏债券型证券投资基金、中银证券安业债券型证券投资基金、中银证券内需增长混合型证券投资基金、中银证券恒瑞 9 个月持有期混合型证券投资基金、中银证券远见价值混合型证券投资基金、中银证券慧泽稳健 3 个

月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、中银证券慧泽平衡 3 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、中银证券安添 3 个月定期开放债券型证券投资基金、中银证券汇裕一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券凌瑞 6 个月持有期混合型证券投资基金、中银证券安澈债券型证券投资基金、中银证券中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、中银证券和瑞一年持有期混合型证券投资基金、中银证券鸿安债券型证券投资基金、中银证券鸿瑞债券型证券投资基金、中银证券中证 A500 指数型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张艺敏	本基金的基金经理	2020 年 9 月 15 日	-	8 年	张艺敏，硕士研究生，中国国籍，已取得证券、基金从业资格。2017 年 7 月至 2020 年 5 月任职于汇安基金管理有限公司，历任产品及创新业务部产品经理、ETF 投资部基金经理助理，2020 年 5 月加入中银国际证券股份有限公司，历任中银证券创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，现任中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中银证券创业板交易型开放式指数证券投资基金、中银证券中证 A500 指数型证券投资基金基金经理。
刘先政	本基金的基金经理	2025 年 8 月 18 日	-	9 年	刘先政，硕士研究生，中国国籍，已取得证券、基金从业资格。曾任太平基金管理有限公司资深行业研究员、百年保险资产管理有限公司高级权益投资经理；2017 年 11 月至 2021 年 4 月任职于诺德基金管理有限公司，担任基金经理；2021 年 4 月加入中银国际证券股份有限公司，历任中银证券安泰债券型证券投资基金、中银证券内需增长混合型证券投资基金、中银证券成长领航混合型证券投资基金基金经理，现任中银证券创业板交易型开放式指数证券投资基金、中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中银证券中证 A500 指数型证券投资基金基金经理。
计伟	本基金的基金经理	2021 年 6 月 8 日	2025 年 9 月 5 日	17 年	计伟，已离任。历任中银证券祥瑞混合型证券投资基金、中银证券瑞益灵活配置混

					合型证券投资基金、中银证券安弘债券型证券投资基金基金经理、中银证券创业板交易型开放式指数证券投资基金、中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、中银证券盈瑞混合型证券投资基金、中银证券中证 A500 指数型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、上述任职日期为根据公司确定的聘任日期，离任日期为根据公司确定的解聘日期；首任基金经理的任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的涵义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无

4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、基金合同以及其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

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

为了保证公司管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益，本基金管理人根据《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，建立了《资产管理业务公平交易管理办法》、《资产管理业务异常交易监控与报告管理办法》等公平交易相关制度体系。

公司基金管理业务、资产管理业务公平交易管理办法所规范的范围涵盖境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，同时涵盖包括授权、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。

公平交易的控制方法主要包括：建立科学、制衡的投资决策体系，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，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；严格隔离投资管理职能和交易执行职能，实行包括所有投资品种的集中交易制度，并进行公平的

交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司一直严格遵循公平交易相关规章制度，执行严格的公平交易行为。在严格方针指导下，报告期内，公司未出现任何异常关联交易以及与禁止交易对手间的交易行为。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗口下（如：1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合向交易开展交易价差分析。分析结果表明，本报告期内公司对各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

无。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发生同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量 5%的情况。

本报告期内，未发现本基金有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

过去一年 A 股市场整体震荡上行，但呈现出较为极致的结构化行情，全年来看中证 500 上涨 30.4%，强于沪深 300、万得全 A，弱于创业板指。全年对指数涨幅正贡献最大的三大成分行业为电子、有色金属、机械，负贡献最大的三大成分行业为煤炭、纺织服装、消费者服务。截至 12 月底，中证 500 指数滚动市盈率 34 倍，处于过去 5 年 99%左右分位。

本基金主要采取完全复制法以紧密跟踪标的指数表现，力争基金跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金的跟踪误差主要来源于基金份额的申购赎回、标的指数成分股调整等。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.5547 元；本报告期基金份额净值增长率为 31.88%，业绩比较基准收益率为 30.39%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们看到过去一年全年维度市场走出较好的表现，但大部分涨幅集中在三季度。指数层面中证 500 虽然成份公司营收整体已出现改善的迹象，但涨幅更多来自于估值的提升，并且除创业板指以外的大部分核心宽基指数近五年的滚动估值都到了 80%以上分位数的水平，这一方面受到统计区间的影响，以及随着科技类成长企业市值占比的逐步提升，传统宽基指数的估值中枢也在上

升，另一方面指数绝对估值水平较历史同期尚有显著差距。同时，我们也看到过去一年市场呈现出较为极致的结构化行情，30 个中信一级行业指数年度涨幅的首尾差距达到 104%，创下近 5 年新高，市场波动性及脆弱性也在同步加大。得益于中证 500 较为均衡的行业结构、对泛科技及顺周期产业的广泛覆盖，指数本身能够较为从容地应对市场主题轮动，过去一年的指数表现跑赢了 74% 的一级行业指数，走出了近 10 年来的最好水平。展望未来，对于 A 股市场积极的政策导向并没有发生变化，企业盈利的改善已有结构性亮点出现，12 月召开的中央经济工作会议及“十五五规划”已为后续的经济工作指明了初步方向。中证 500 能够较好捕捉大行业里的中游企业及小行业里的头部企业的成长潜力，在流动性相对宽松的环境下相较大盘指数具有一定弹性优势。本基金作为一只投资于中证 500 的指数产品，将继续秉承指数化投资策略，严格遵守基金合同，积极应对基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，降低本基金的跟踪误差，为投资者提供一个标准化的中证 500 指数投资工具。

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，本基金管理人始终坚持基金份额持有人利益优先原则，从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实。公司审计部依据法律法规的规定及公司内部控制的整体要求，独立对旗下基金投资组合、基金宣传推介材料及员工行为等的合规性进行了定期和不定期检查，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，并定期出具监察稽核报告。

在合规管理方面，公司开展多种形式的合规培训，定期进行合规信息收集，不断提升员工的合规守法意识；加强事前事中合规风险管理，严格审核信息披露文件、基金宣传推介材料，防范各类合规风险。在风险管理方面，公司秉承全员风险管理的理念，采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，加强对日常投资运作的管理和监控，督促投研交易业务的合规开展；在监察稽核方面，公司定期和不定期开展内部稽核，对投资研究、公平交易、基金销售，投资管理人员通讯管理等关键业务和岗位进行检查监督，促进公募基金业务合规运作、稳健经营。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作有效性，切实保障基金安全、合规运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了中银国际证券股份有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。由公司领导担任主席，成员由资产管理板块负

责人、基金管理部、信评与投资监督部、运营管理总部、内控与法律合规部、风险管理部等部门负责人组成。估值委员会成员均具有专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力，具有绝对的独立性。估值委员会的职责主要包括有：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理人作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内未实施利润分配。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 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

本基金报告期内不存在连续二十个工作日基金持有人数低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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 2602794 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	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的中银证券中证 500 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，2025 年度的利润表、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 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。
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。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	该基金管理人中银国际证券股份有限公司(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。
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。
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。	
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	倪益	谢晶菁
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层	
审计报告日期	2026 年 3 月 30 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中银证券中证 500 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	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	9,537,348.46	604,108.99
结算备付金		575,194.92	17,364.75
存出保证金		122,014.54	9,199.36
交易性金融资产	7.4.7.2	810,861,375.64	88,519,420.71
其中：股票投资		810,779,374.38	88,519,420.71
基金投资		-	-
债券投资		82,001.26	-
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	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		13,463,626.27	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		834,559,559.83	89,150,093.81
负 债 和 净 资 产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负 债：			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		17,331,955.60	0.18
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		84,116.95	11,956.87
应付托管费		28,038.97	3,985.61
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.07	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	184,170.56	163,701.99
负债合计		17,628,282.15	179,644.65
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	525,466,080.00	75,466,080.00
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	291,465,197.68	13,504,369.16
净资产合计		816,931,277.68	88,970,449.16
负债和净资产总计		834,559,559.83	89,150,093.81

注： 报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.5547 元，基金份额总额 525,466,080.00 份。

7.2 利润表

会计主体：中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 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 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		53,805,948.20	7,251,448.70
1. 利息收入		8,154.25	3,288.67
其中：存款利息收入	7.4.7.13	8,154.25	3,288.67
债券利息收入		-	-
资产支持证券利 息收入		-	-
买入返售金融资 产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		14,823,443.15	-2,122,542.98

其中：股票投资收益	7.4.7.14	12,657,776.46	-3,425,625.90
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	78,235.32	1,502.00
资产支持证券投资 收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	2,087,431.37	1,301,580.92
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产 生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	7.4.7.20	38,265,215.95	9,176,018.15
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.21	709,134.85	194,684.86
减：二、营业总支出		748,835.26	545,634.96
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	330,749.99	103,413.10
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	110,250.08	34,471.04
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.04	0.02
8. 其他费用	7.4.7.23	307,835.15	407,750.80
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		53,057,112.94	6,705,813.74
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		53,057,112.94	6,705,813.74
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		53,057,112.94	6,705,813.74

7.3 净资产变动表

会计主体：中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 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	75,466,080.00	-	13,504,369.16	88,970,449.16
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	75,466,080.00	-	13,504,369.16	88,970,449.16
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	450,000,000.00	-	277,960,828.52	727,960,828.52
（一）、综合收益总额	-	-	53,057,112.94	53,057,112.94
（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）	450,000,000.00	-	224,903,715.58	674,903,715.58
其中：1. 基金申购款	560,000,000.00	-	277,778,807.49	837,778,807.49
2. 基金赎回款	-110,000,000.00	-	-52,875,091.91	-162,875,091.91
（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）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	525,466,080.00	-	291,465,197.68	816,931,277.68
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	55,466,080.00	-	5,751,030.72	61,217,110.72

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	55,466,080.00	-	5,751,030.72	61,217,110.72
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	20,000,000.00	-	7,753,338.44	27,753,338.44
(一)、综合收益总额	-	-	6,705,813.74	6,705,813.74
(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)	20,000,000.00	-	1,047,524.70	21,047,524.70
其中：1. 基金申购款	50,000,000.00	-	4,424,378.95	54,424,378.95
2. 基金赎回款	-30,000,000.00	-	-3,376,854.25	-33,376,854.25
(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)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	75,466,080.00	-	13,504,369.16	88,970,449.16

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：

周冰

沈锋

戴景义

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

中银证券中证 500 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[2019]2052号《关于准予中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册,由中银国际证券股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息(含募集股票市值)共募集人民币 251,438,000.00 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第 0351 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2020 年 4 月 30 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 251,466,080.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 28,080.00 份基金份额。本基金的基金管理人为中银国际证券股份有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2020]135 号文核准,本基金于 2020 年 5 月 27 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金还可投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证)、股指期货、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债的纯债部分、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持债券、政府支持机构债券等)、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款和其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、资产支持证券、债券回购以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金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%。每个交易日日终在扣除股指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。本基金的业绩比较基准为:中证 500 指数收益率。

本基金的基金管理人中银国际证券股份有限公司以本基金为目标 ETF,募集成立了中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“中证 500ETF 联接基金”)。中证 500ETF 联接基金为交易型开放式基金,投资目标与本基金类似,将绝大多数基金资产投资于本基金。

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、2025年度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。

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

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

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为:以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。

本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

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

- 以摊余成本计量:

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

– 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

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

(2) 金融负债

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

(3) 衍生金融工具

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金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

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

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。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；(2) 本基金的收益分配采取现金分红的方式；(3) 《中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；(4) 每一基金份额享有同等分配权；(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。在不违反法律法规规定与基金合同约定且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒介公告。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并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 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》（以下简称“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或减值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财税[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。

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	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	9,537,348.46	604,108.99
等于：本金	9,536,714.85	604,031.69
加：应计利息	633.61	77.30
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	9,537,348.46	604,108.99

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		771,769,831.82	-	810,779,374.38	39,009,542.56
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	82,000.00	1.26	82,001.26	0.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	82,000.00	1.26	82,001.26	0.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		771,851,831.82	1.26	810,861,375.64	39,009,542.56
项目		上年度末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		87,775,094.10	-	88,519,420.71	744,326.61
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		87,775,094.10	-	88,519,420.71	744,326.61

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

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

注：本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

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

注：本基金本报告期末及上年度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

注：本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间未计提买入返售金融资产减值准备。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有债权投资。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未计提债权投资减值准备。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他债权投资。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未计提其他债权投资减值准备。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他权益工具投资。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他权益工具投资。

7.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	60,320.56	4,851.99
其中：交易所市场	60,320.56	4,851.99
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	123,850.00	123,850.00
应付指数使用费	-	35,000.00
合计	184,170.56	163,701.99

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	75,466,080.00	75,466,080.00
本期申购	560,000,000.00	560,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-110,000,000.00	-110,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	525,466,080.00	525,466,080.00

7.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期无其他综合收益。

7.4.7.12 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
上年度末	38,263,489.59	-24,759,120.43	13,504,369.16
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	38,263,489.59	-24,759,120.43	13,504,369.16
本期利润	14,791,896.99	38,265,215.95	53,057,112.94
本期基金份额交易产生的变动数	256,198,699.77	-31,294,984.19	224,903,715.58
其中：基金申购款	318,597,048.59	-40,818,241.10	277,778,807.49
基金赎回款	-62,398,348.82	9,523,256.91	-52,875,091.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	309,254,086.35	-17,788,888.67	291,465,197.68

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	7,148.28	2,538.49
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	906.74	648.71
其他	99.23	101.47
合计	8,154.25	3,288.67

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	8,973,015.91	-2,663,606.64
股票投资收益——赎回差价收入	3,684,760.55	-762,019.26
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	12,657,776.46	-3,425,625.90

7.4.7.14.2 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 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	223,410,209.12	37,859,939.14
减：卖出股票成本总额	214,117,449.74	40,460,843.47
减：交易费用	319,743.47	62,702.31
买卖股票差价收入	8,973,015.91	-2,663,606.64

7.4.7.14.3 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1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
赎回基金份额对价总额	162,875,091.91	33,376,854.25
减：现金支付赎回款总额	84,298,345.91	17,785,924.25
减：赎回股票成本总额	74,891,985.45	16,352,949.26
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	3,684,760.55	-762,019.26

7.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益-申购差价收入。

7.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益-证券出借差价收入。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
债券投资收益——利息收入	15.91	7.93

债券投资收益——买卖 债券（债转股及债券到 期兑付）差价收入	78,219.41	1,494.07
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	78,235.32	1,502.00

7.4.7.15.2 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1日至2025年12月31 日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31 日
卖出债券（债转股及债券 到期兑付）成交总额	254,844.75	57,504.53
减：卖出债券（债转股及 债券到期兑付）成本总额	176,600.00	56,000.00
减：应计利息总额	15.13	8.16
减：交易费用	10.21	2.30
买卖债券差价收入	78,219.41	1,494.07

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益-申购差价收入。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益-申购差价收入。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益-申购差价收入。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益-其他投资收益。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	2,087,431.37	1,301,580.92
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	2,087,431.37	1,301,580.92

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	38,265,215.95	9,176,018.15
股票投资	38,265,215.95	9,176,018.15
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	38,265,215.95	9,176,018.15

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	709,134.85	194,684.86
合计	709,134.85	194,684.86

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

7.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无信用减值损失。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
审计费用	23,850.00	15,850.00
信息披露费	80,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	3,117.97	1,850.00
指数使用费	30,722.22	140,000.00
其他费用	170,144.96	170,050.80
合计	307,835.15	407,750.80

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的年费率 0.03%每日计提，按季支付。标的指数许可使用费的收取下限为：就每个计费季度而言，如当季度日均基金资产净值大于 5,000 万元的，指数使用费的收取下限为每季度 35,000 元；如当季度日均基金资产净值小于或等于 5,000 万元的，无指数许可使用费的收取下限。

自 2025 年 3 月 21 日起，本基金产生的指数使用费，由基金管理人承担，不再从基金资产中列支。

7.4.7.24 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中银国际证券股份有限公司（“中银证券”）	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	中银国际控股有限公司（基金管理人股东）的控股股东
中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“中证 500ETF 联接基金”）	基金管理人管理的其他基金
国机重型装备集团股份有限公司（“国机重装”）	基金管理人的关联方

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
中银证券	800,061,213.43	100.00	88,531,518.41	100.00

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
中银证券	254,844.75	100.00	57,504.53	100.00

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

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1月1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 (%)
中银证券	156,743.95	100.00	60,320.56	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
中银证券	38,090.89	100.00	4,851.99	100.00

注：1、上述佣金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，2024年6月30日起证券交易佣金费率水平按照中国证券监督管理委员会于2024年4月19日制定发布的《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》相关要求执行。

2、因基金管理人中银证券属于具有公募管理人资格的综合类券商，根据交易所会员交易席位管理的相关要求，基金管理人旗下公募基金参与证券交易仅能使用基金管理人自有交易席位进行，暂不能使用其他证券公司的交易席位进行证券交易。

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1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	330,749.99	103,413.10
其中：应支付销售机构的客户维护费	143.13	73.59
应支付基金管理人的净管理费	330,606.86	103,339.51

注：支付基金管理人中银证券的基金管理费按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提，逐日累

计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	110,250.08	34,471.04

注：支付基金托管人招商银行的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。计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无支付给各关联方的销售服务费。

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

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

注：本基金管理人于本报告期内及上年度可比期间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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025 年 12 月 31 日		上年度末 2024 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（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）

中证500ETF联接基金	401,254,680.00	76.3617	63,932,680.00	84.7171
--------------	----------------	---------	---------------	---------

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 1 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	9,537,348.46	7,148.28	604,108.99	2,538.49

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

为更紧密地跟踪标的指数，降低跟踪误差，本基金在报告期内投资于关联方发行的普通股中银证券（601696.SH）和国机重装（601399.SH）。

于本报告期末，本基金持有中银证券 144,600 股，占基金净值比例 0.27%（上年度末：本基金持有中银证券 20,800 股，占基金净值比例 0.26%）。

于本报告期末，本基金持有国机重装 249,900 股，占基金净值比例 0.15%（上年度末：无）。

7.4.11 利润分配情况

注：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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
118063	金 05 转债	2025 年 12 月 25 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	820	82,000.00	82,001.26	-

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
------	------	------	------	--------	------	--------	-------	--------	--------	----

400174	中天 3	2023 年 8 月 30 日	暂停转 让	0.00	-	-	44,600	126,944.97	0.00	-
--------	------	--------------------------	----------	------	---	---	--------	------------	------	---

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

注：本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末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

本基金主要投资于股票、债券等具有良好流动性的金融工具。与这些金融工具相关的风险，以及本基金的基金管理人对于相关风险采取的风险管理政策如下所述。

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 500 指数，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，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪中证 500 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在公司风险管理体系的基础上构建明晰基金业务的风险管理组织架构和职能，由董事会及其风险控制委员会、总裁办公会、风险管理委员会、风险管理部、基金管理部、中后线部门等相关业务部门构成多层次风险管理框架体系。董事会决定公司风险偏好，并在风险控制委员会的协助下监察公司基金业务的总体风险及管理状况。总裁办公会领导公司基金业务的风险管理。风险管理委员会协助总裁办公会在董事会授权范围内听取和审议包括公募基金在内的资产管理业务风险相关报告，评估风险管理状况。在业务操作层面，风险管理部、信评与投资监督部负责落实公司基金业务的风险管理制度，协调并与各部门合作履行风险管理职责。业务主管对各自业务的风险管理负有首要责任。财务部、运营管理总部、审计部、内控与法律合规部等中后线部门在各自职能范围内支持或监督公司风险管理。

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在本基金的托管人招商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	82,001.26	-
未评级	-	-
合计	82,001.26	-

注：本基金上年度末未持有按长期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

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来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于 2025 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息。本基金赎回基金采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：不适用。

7.4.13.3.2 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。

本基金所持证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见“期末本基金持有的流通受限证券”附注。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2025 年 12 月 31 日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未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。于 2025 年 12 月 31 日，本基金确认的净赎回申请未超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允

价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

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

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	9,537,348.46	-	-	-	9,537,348.46
结算备付金	575,194.92	-	-	-	575,194.92
存出保证金	122,014.54	-	-	-	122,014.54
交易性金融资产	82,001.26	-	-	810,779,374.38	810,861,375.64
应收清算款	-	-	-	13,463,626.27	13,463,626.27
资产总计	10,316,559.18	-	-	824,243,000.65	834,559,559.83
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	84,116.95	84,116.95
应付托管费	-	-	-	28,038.97	28,038.97
应付清算款	-	-	-	17,331,955.60	17,331,955.60
应交税费	-	-	-	0.07	0.07
其他负债	-	-	-	184,170.56	184,170.56
负债总计	-	-	-	17,628,282.15	17,628,282.15
利率敏感度缺口	10,316,559.18	-	-	806,614,718.50	816,931,277.68
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	604,108.99	-	-	-	604,108.99

结算备付金	17,364.75	-	-	-	17,364.75
存出保证金	9,199.36	-	-	-	9,199.36
交易性金融资产	-	-	-	88,519,420.71	88,519,420.71
资产总计	630,673.10	-	-	88,519,420.71	89,150,093.81
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	11,956.87	11,956.87
应付托管费	-	-	-	3,985.61	3,985.61
应付清算款	-	-	-	0.18	0.18
其他负债	-	-	-	163,701.99	163,701.99
负债总计	-	-	-	179,644.65	179,644.65
利率敏感度缺口	630,673.10	-	-	88,339,776.06	88,970,449.16

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2025 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为 0.01%（2024 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净资产无重大影响（2024 年 12 月 31 日：同）。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：不适用。

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：不适用。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能

带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将通过投资非成份股、成份股个股衍生品等方式进行替代，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。

本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的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，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	810,779,374.38	99.25	88,519,420.71	99.49
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	810,779,374.38	99.25	88,519,420.71	99.49

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 12 月 31 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	40,569,964.45	4,405,913.28
	业绩比较基准下降 5%	-40,569,964.45	-4,405,913.28

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：不适用。

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：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：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	810,779,374.38	88,519,420.71
第二层次	82,001.26	—
第三层次	—	—
合计	810,861,375.64	88,519,420.71

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有第三层次公允价值余额及变动。

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	-	重置成本法	调整后净资产	小于 0	正相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	-	重置成本法	调整后净资产	小于 0	正相关

注：本基金本期末及上年度末未持有第三层次金融资产。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2025 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产 (2024 年 12 月 31 日：同)。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	810,779,374.38	97.15
	其中：股票	810,779,374.38	97.15
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	82,001.26	0.01
	其中：债券	82,001.26	0.01
	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	10,112,543.38	1.21

8	其他各项资产	13,585,640.81	1.63
9	合计	834,559,559.83	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款估值增值。

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	3,853,429.00	0.47
B	采矿业	33,985,864.00	4.16
C	制造业	553,130,491.47	67.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	23,442,037.24	2.87
E	建筑业	6,590,223.00	0.81
F	批发和零售业	12,160,886.72	1.49
G	交通运输、仓储和邮政业	12,068,988.00	1.48
H	住宿和餐饮业	1,008,273.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	67,756,278.13	8.29
J	金融业	59,886,870.44	7.33
K	房地产业	5,716,747.00	0.70
L	租赁和商务服务业	10,022,213.80	1.23
M	科学研究和技术服务业	5,343,924.26	0.65
N	水利、环境和公共设施管理业	3,526,638.60	0.43
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	1,167,240.00	0.14
Q	卫生和社会工作	2,511,682.64	0.31
R	文化、体育和娱乐业	5,689,542.00	0.70
S	综合	2,918,143.00	0.36
	合计	810,779,472.30	99.25

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	—	—
C	制造业	—	—
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—

E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	0.00	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	0.00	0.00

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

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	002837	英维克	50,300	5,376,567.00	0.66
2	300136	信维通信	83,400	5,170,800.00	0.63
3	002558	巨人网络	116,500	5,043,285.00	0.62
4	002738	中矿资源	61,920	4,863,816.00	0.60
5	600879	航天电子	224,800	4,792,736.00	0.59
6	300450	先导智能	95,200	4,758,096.00	0.58
7	600118	中国卫星	50,100	4,756,995.00	0.58
8	600580	卧龙电驱	94,980	4,663,518.00	0.57
9	600988	赤峰黄金	144,400	4,511,056.00	0.55
10	000426	兴业银锡	123,100	4,382,360.00	0.54
11	002202	金风科技	208,800	4,259,520.00	0.52
12	600487	亨通光电	171,100	4,231,303.00	0.52
13	601168	西部矿业	144,700	3,999,508.00	0.49

14	600549	厦门钨业	96,399	3,958,142.94	0.48
15	002156	通富微电	104,900	3,954,730.00	0.48
16	002532	天山铝业	240,900	3,897,762.00	0.48
17	688347	华虹公司	36,015	3,884,938.05	0.48
18	300604	长川科技	37,800	3,829,518.00	0.47
19	300115	长盈精密	81,900	3,808,350.00	0.47
20	002353	杰瑞股份	53,000	3,753,990.00	0.46
21	000933	神火股份	135,800	3,730,426.00	0.46
22	002340	格林美	442,100	3,695,956.00	0.45
23	600096	云天化	110,000	3,675,100.00	0.45
24	301308	江波龙	15,000	3,672,600.00	0.45
25	002261	拓维信息	108,700	3,597,970.00	0.44
26	300395	菲利华	35,600	3,570,680.00	0.44
27	600143	金发科技	182,300	3,562,142.00	0.44
28	300857	协创数据	21,100	3,559,148.00	0.44
29	300058	蓝色光标	304,340	3,505,996.80	0.43
30	002195	岩山科技	490,300	3,476,227.00	0.43
31	300339	润和软件	69,200	3,425,400.00	0.42
32	688120	华海清科	22,792	3,420,623.36	0.42
33	002851	麦格米特	37,500	3,377,625.00	0.41
34	688525	佰维存储	29,300	3,363,347.00	0.41
35	300207	欣旺达	127,800	3,341,970.00	0.41
36	688002	睿创微纳	32,716	3,297,772.80	0.40
37	600885	宏发股份	106,832	3,247,692.80	0.40
38	002517	恺英网络	148,100	3,238,947.00	0.40
39	002966	苏州银行	386,570	3,204,665.30	0.39
40	002131	利欧股份	567,100	3,198,444.00	0.39
41	603228	景旺电子	43,000	3,142,870.00	0.38
42	002402	和而泰	79,800	3,121,776.00	0.38
43	002436	兴森科技	147,300	3,118,341.00	0.38
44	601555	东吴证券	343,350	3,110,751.00	0.38
45	300751	迈为股份	15,000	3,089,850.00	0.38
46	300223	北京君正	29,000	3,075,160.00	0.38
47	600601	方正科技	258,600	3,030,792.00	0.37
48	002273	水晶光电	120,600	3,029,472.00	0.37
49	688122	西部超导	39,909	2,976,413.22	0.36
50	600157	永泰能源	1,885,100	2,959,607.00	0.36
51	002281	光迅科技	42,300	2,958,885.00	0.36
52	000831	中国稀土	63,600	2,953,584.00	0.36
53	002008	大族激光	71,500	2,945,085.00	0.36
54	600673	东阳光	130,100	2,918,143.00	0.36
55	688469	芯联集成	435,100	2,910,819.00	0.36
56	002595	豪迈科技	34,200	2,890,242.00	0.35

57	002130	沃尔核材	108,700	2,860,984.00	0.35
58	002472	双环传动	58,400	2,768,744.00	0.34
59	689009	九号公司	49,725	2,764,212.75	0.34
60	002126	银轮股份	72,900	2,755,620.00	0.34
61	300390	天华新能	50,310	2,747,429.10	0.34
62	002128	电投能源	97,200	2,712,852.00	0.33
63	002465	海格通信	172,100	2,710,575.00	0.33
64	688777	中控技术	54,600	2,693,964.00	0.33
65	002850	科达利	17,000	2,683,620.00	0.33
66	688361	中科飞测	17,300	2,646,727.00	0.32
67	600699	均胜电子	84,100	2,637,376.00	0.32
68	688099	晶晨股份	30,200	2,634,346.00	0.32
69	600392	盛和资源	121,600	2,618,048.00	0.32
70	301358	湖南裕能	40,000	2,586,400.00	0.32
71	688578	艾力斯	24,707	2,573,234.05	0.31
72	300346	南大光电	59,400	2,548,260.00	0.31
73	688027	国盾量子	5,057	2,547,666.03	0.31
74	688235	百济神州	9,475	2,544,985.00	0.31
75	603659	璞泰来	92,900	2,539,886.00	0.31
76	300454	深信服	22,000	2,533,520.00	0.31
77	601162	天风证券	609,000	2,533,440.00	0.31
78	002797	第一创业	363,300	2,495,871.00	0.31
79	000878	云南铜业	121,600	2,494,016.00	0.31
80	002138	顺络电子	70,100	2,490,653.00	0.30
81	300054	鼎龙股份	65,900	2,477,840.00	0.30
82	688385	复旦微电	33,358	2,458,484.60	0.30
83	603129	春风动力	8,800	2,452,384.00	0.30
84	601108	财通证券	281,200	2,452,064.00	0.30
85	600021	上海电力	122,300	2,448,446.00	0.30
86	603979	金诚信	32,100	2,444,415.00	0.30
87	688213	思特威	25,560	2,430,500.40	0.30
88	002185	华天科技	220,900	2,423,273.00	0.30
89	601099	太平洋	589,600	2,423,256.00	0.30
90	600352	浙江龙盛	225,400	2,402,764.00	0.29
91	000021	深科技	94,900	2,399,072.00	0.29
92	002294	信立泰	48,400	2,398,220.00	0.29
93	300037	新宙邦	45,576	2,388,182.40	0.29
94	000960	锡业股份	85,000	2,369,800.00	0.29
95	000783	长江证券	286,700	2,336,605.00	0.29
96	600141	兴发集团	67,300	2,327,234.00	0.28
97	601198	东兴证券	167,100	2,319,348.00	0.28
98	300724	捷佳伟创	24,200	2,313,520.00	0.28
99	000893	亚钾国际	48,100	2,307,357.00	0.28

100	601717	中创智领	93,800	2,302,790.00	0.28
101	600298	安琪酵母	52,500	2,296,350.00	0.28
102	002078	太阳纸业	145,400	2,290,050.00	0.28
103	688676	金盘科技	25,111	2,268,527.74	0.28
104	601615	明阳智能	156,400	2,264,672.00	0.28
105	603179	新泉股份	30,600	2,260,728.00	0.28
106	300474	景嘉微	31,400	2,256,718.00	0.28
107	600536	中国软件	48,549	2,247,818.70	0.28
108	002271	东方雨虹	164,700	2,238,273.00	0.27
109	688608	恒玄科技	9,700	2,201,318.00	0.27
110	688183	生益电子	23,000	2,200,870.00	0.27
111	000657	中钨高新	78,700	2,180,777.00	0.27
112	600498	烽火通信	67,900	2,178,232.00	0.27
113	300017	网宿科技	212,400	2,177,100.00	0.27
114	002414	高德红外	148,000	2,171,160.00	0.27
115	601696	中银证券	144,600	2,167,554.00	0.27
116	601233	桐昆股份	125,000	2,151,250.00	0.26
117	300073	当升科技	37,100	2,144,380.00	0.26
118	601665	齐鲁银行	371,900	2,134,706.00	0.26
119	300496	中科创达	31,600	2,133,000.00	0.26
120	688019	安集科技	9,700	2,113,824.00	0.26
121	688568	中科星图	35,700	2,106,300.00	0.26
122	603606	东方电缆	35,200	2,103,200.00	0.26
123	600884	杉杉股份	155,600	2,102,156.00	0.26
124	300458	全志科技	50,000	2,101,500.00	0.26
125	002080	中材科技	57,700	2,096,818.00	0.26
126	002444	巨星科技	61,500	2,092,230.00	0.26
127	603087	甘李药业	30,700	2,089,749.00	0.26
128	600109	国金证券	224,600	2,088,780.00	0.26
129	002157	正邦科技	640,100	2,073,924.00	0.25
130	002085	万丰奥威	128,500	2,057,285.00	0.25
131	688017	绿的谐波	10,600	2,036,260.00	0.25
132	601577	长沙银行	208,500	2,022,450.00	0.25
133	601128	常熟银行	286,601	2,017,671.04	0.25
134	601179	中国西电	220,900	2,010,190.00	0.25
135	300748	金力永磁	58,840	2,007,032.40	0.25
136	002155	湖南黄金	95,000	2,003,550.00	0.25
137	300699	光威复材	50,380	1,987,994.80	0.24
138	002223	鱼跃医疗	52,000	1,986,920.00	0.24
139	300012	华测检测	145,900	1,976,945.00	0.24
140	300024	机器人	108,100	1,966,339.00	0.24
141	300002	神州泰岳	170,600	1,965,312.00	0.24
142	000559	万向钱潮	113,700	1,955,640.00	0.24

143	300757	罗博特科	8,300	1,936,390.00	0.24
144	002624	完美世界	118,000	1,934,020.00	0.24
145	000034	神州数码	49,300	1,918,263.00	0.23
146	600363	联创光电	30,400	1,917,024.00	0.23
147	002683	广东宏大	40,000	1,912,000.00	0.23
148	603160	汇顶科技	24,200	1,911,800.00	0.23
149	300373	扬杰科技	28,100	1,910,800.00	0.23
150	600497	驰宏锌锗	261,300	1,910,103.00	0.23
151	300919	中伟新材	41,100	1,904,163.00	0.23
152	300285	国瓷材料	69,400	1,902,254.00	0.23
153	688220	翱捷科技	22,962	1,896,890.82	0.23
154	000728	国元证券	226,700	1,892,945.00	0.23
155	002064	华峰化学	172,000	1,892,000.00	0.23
156	000423	东阿阿胶	38,400	1,884,672.00	0.23
157	688599	天合光能	112,600	1,863,530.00	0.23
158	603596	伯特利	36,200	1,855,974.00	0.23
159	600765	中航重机	95,720	1,833,995.20	0.22
160	002409	雅克科技	24,700	1,830,270.00	0.22
161	002673	西部证券	231,900	1,829,691.00	0.22
162	002410	广联达	142,200	1,788,876.00	0.22
163	600079	ST 人福	98,600	1,785,646.00	0.22
164	603920	世运电路	36,800	1,781,488.00	0.22
165	002065	东华软件	193,400	1,769,610.00	0.22
166	300003	乐普医疗	111,200	1,758,072.00	0.22
167	002756	永兴材料	32,300	1,752,275.00	0.21
168	000733	振华科技	33,200	1,740,012.00	0.21
169	000997	新大陆	60,900	1,724,688.00	0.21
170	600873	梅花生物	170,200	1,724,126.00	0.21
171	600637	东方明珠	174,700	1,720,795.00	0.21
172	002335	科华数据	30,900	1,715,877.00	0.21
173	603766	隆鑫通用	106,400	1,714,104.00	0.21
174	600862	中航高科	72,500	1,713,175.00	0.21
175	601231	环旭电子	56,800	1,704,000.00	0.21
176	002318	久立特材	58,800	1,702,260.00	0.21
177	688617	惠泰医疗	6,966	1,694,618.82	0.21
178	000703	恒逸石化	155,700	1,676,889.00	0.21
179	000683	博源化工	225,300	1,676,232.00	0.21
180	000932	华菱钢铁	298,000	1,674,760.00	0.21
181	300627	华测导航	47,740	1,666,603.40	0.20
182	000528	柳工	140,000	1,661,800.00	0.20
183	600060	海信视像	68,200	1,655,896.00	0.20
184	300570	太辰光	14,300	1,652,365.00	0.20
185	605589	圣泉集团	58,200	1,647,060.00	0.20

186	002821	凯莱英	17,700	1,644,861.00	0.20
187	600909	华安证券	242,210	1,642,183.80	0.20
188	000830	鲁西化工	99,000	1,640,430.00	0.20
189	000750	国海证券	386,500	1,638,760.00	0.20
190	603486	科沃斯	20,300	1,637,804.00	0.20
191	605358	立昂微	46,700	1,626,094.00	0.20
192	300001	特锐德	63,300	1,625,544.00	0.20
193	000623	吉林敖东	82,500	1,611,225.00	0.20
194	000039	中集集团	159,050	1,604,814.50	0.20
195	688065	凯赛生物	32,146	1,600,870.80	0.20
196	600737	中粮糖业	93,000	1,600,530.00	0.20
197	000887	中鼎股份	68,700	1,594,527.00	0.20
198	688180	君实生物	46,582	1,591,241.12	0.19
199	300567	精测电子	17,300	1,577,760.00	0.19
200	000400	许继电气	61,200	1,573,452.00	0.19
201	688234	天岳先进	17,673	1,570,776.24	0.19
202	000060	中金岭南	268,300	1,569,555.00	0.19
203	300972	万辰集团	7,800	1,568,346.00	0.19
204	300677	英科医疗	40,240	1,565,336.00	0.19
205	300383	光环新网	124,600	1,558,746.00	0.19
206	600332	白云山	60,400	1,554,696.00	0.19
207	600369	西南证券	344,300	1,542,464.00	0.19
208	600171	上海贝岭	49,200	1,537,500.00	0.19
209	000009	中国宝安	156,000	1,536,600.00	0.19
210	688387	信科移动	118,700	1,531,230.00	0.19
211	600521	华海药业	90,000	1,527,300.00	0.19
212	603444	吉比特	3,600	1,525,860.00	0.19
213	600177	雅戈尔	200,200	1,521,520.00	0.19
214	688629	华丰科技	15,200	1,520,912.00	0.19
215	001696	宗申动力	69,700	1,511,793.00	0.19
216	002203	海亮股份	119,400	1,511,604.00	0.19
217	601990	南京证券	190,700	1,510,344.00	0.18
218	300142	沃森生物	137,900	1,504,489.00	0.18
219	601212	白银有色	256,200	1,498,770.00	0.18
220	300763	锦浪科技	20,900	1,492,469.00	0.18
221	600704	物产中大	267,800	1,491,646.00	0.18
222	603568	伟明环保	58,660	1,488,790.80	0.18
223	688052	纳芯微	9,394	1,485,942.92	0.18
224	601997	贵阳银行	253,100	1,485,697.00	0.18
225	002152	广电运通	107,200	1,480,432.00	0.18
226	688322	奥比中光	16,500	1,479,555.00	0.18
227	300432	富临精工	88,200	1,472,940.00	0.18
228	600486	扬农化工	21,210	1,471,761.90	0.18

229	000738	航发控制	68,700	1,463,997.00	0.18
230	601799	星宇股份	11,800	1,455,766.00	0.18
231	002739	万达电影	127,900	1,447,828.00	0.18
232	002429	兆驰股份	195,000	1,446,900.00	0.18
233	002007	华兰生物	95,200	1,440,376.00	0.18
234	600378	昊华科技	44,900	1,435,004.00	0.18
235	603345	安井食品	18,100	1,434,968.00	0.18
236	688702	盛科通信	10,100	1,431,069.00	0.18
237	002044	美年健康	270,200	1,426,656.00	0.17
238	603605	珀莱雅	20,800	1,424,384.00	0.17
239	600208	衢州发展	367,500	1,422,225.00	0.17
240	600435	北方导航	92,000	1,418,640.00	0.17
241	600801	华新建材	57,800	1,418,412.00	0.17
242	688266	泽璟制药	15,300	1,418,310.00	0.17
243	002939	长城证券	139,000	1,417,800.00	0.17
244	688018	乐鑫科技	8,300	1,411,000.00	0.17
245	002841	视源股份	35,600	1,410,828.00	0.17
246	601216	君正集团	291,500	1,405,030.00	0.17
247	601611	中国核建	104,200	1,404,616.00	0.17
248	688114	华大智造	23,028	1,399,181.28	0.17
249	600153	建发股份	150,600	1,393,050.00	0.17
250	603699	纽威股份	26,800	1,392,796.00	0.17
251	601567	三星医疗	60,300	1,388,106.00	0.17
252	600516	方大炭素	243,100	1,383,239.00	0.17
253	600499	科达制造	99,700	1,382,839.00	0.17
254	002056	横店东磁	70,700	1,378,650.00	0.17
255	000729	燕京啤酒	122,200	1,372,306.00	0.17
256	688375	国博电子	14,703	1,368,996.33	0.17
257	300487	蓝晓科技	22,150	1,367,762.50	0.17
258	603728	鸣志电器	18,500	1,338,475.00	0.16
259	301611	珂玛科技	15,600	1,337,388.00	0.16
260	603816	顾家家居	43,000	1,321,820.00	0.16
261	000519	中兵红箭	72,500	1,320,225.00	0.16
262	688615	合合信息	5,800	1,319,964.00	0.16
263	688166	博瑞医药	26,834	1,316,476.04	0.16
264	600642	申能股份	168,600	1,311,708.00	0.16
265	601958	金钼股份	83,400	1,299,372.00	0.16
266	000415	渤海租赁	320,300	1,297,215.00	0.16
267	603379	三美股份	21,360	1,296,979.20	0.16
268	000155	川能动力	111,300	1,296,645.00	0.16
269	688188	柏楚电子	9,523	1,294,080.47	0.16
270	688778	厦钨新能	16,645	1,287,823.65	0.16
271	600348	华阳股份	155,900	1,287,734.00	0.16

272	600316	洪都航空	36,700	1,281,197.00	0.16
273	002430	杭氧股份	42,700	1,275,449.00	0.16
274	002262	恩华药业	52,600	1,269,238.00	0.16
275	688538	和辉光电	477,000	1,268,820.00	0.16
276	600038	中直股份	35,000	1,264,550.00	0.15
277	600863	内蒙华电	282,200	1,264,256.00	0.15
278	002926	华西证券	135,800	1,260,224.00	0.15
279	688772	珠海冠宇	58,384	1,257,007.52	0.15
280	600398	海澜之家	207,600	1,255,980.00	0.15
281	603338	浙江鼎力	22,100	1,251,744.00	0.15
282	300679	电连技术	25,700	1,251,076.00	0.15
283	603806	福斯特	89,600	1,250,816.00	0.15
284	000723	美锦能源	266,100	1,250,670.00	0.15
285	000629	钒钛股份	401,000	1,243,100.00	0.15
286	603156	养元饮品	43,200	1,242,000.00	0.15
287	001389	广合科技	15,200	1,240,776.00	0.15
288	600967	内蒙一机	73,800	1,239,840.00	0.15
289	002603	以岭药业	72,500	1,237,575.00	0.15
290	600820	隧道股份	189,800	1,231,802.00	0.15
291	688692	达梦数据	4,700	1,227,969.00	0.15
292	600901	江苏金租	200,600	1,227,672.00	0.15
293	600312	平高电气	70,700	1,226,645.00	0.15
294	600562	国睿科技	43,400	1,226,484.00	0.15
295	600170	上海建工	461,100	1,221,915.00	0.15
296	601699	潞安环能	103,400	1,220,120.00	0.15
297	603298	杭叉集团	45,600	1,211,592.00	0.15
298	603077	和邦生物	533,700	1,206,162.00	0.15
299	600166	福田汽车	410,800	1,199,536.00	0.15
300	601399	国机重装	249,900	1,194,522.00	0.15
301	002958	青农商行	384,400	1,191,640.00	0.15
302	002025	航天电器	23,700	1,188,081.00	0.15
303	002385	大北农	296,800	1,187,200.00	0.15
304	688297	中无人机	24,700	1,186,094.00	0.15
305	300623	捷捷微电	43,600	1,184,612.00	0.15
306	603737	三棵树	25,544	1,181,920.88	0.14
307	601106	中国一重	295,900	1,180,641.00	0.14
308	003031	中瓷电子	16,040	1,173,486.40	0.14
309	600970	中材国际	112,900	1,173,031.00	0.14
310	300100	双林股份	29,500	1,168,790.00	0.14
311	002607	中公教育	426,000	1,167,240.00	0.14
312	600563	法拉电子	11,100	1,164,945.00	0.14
313	000050	深天马 A	127,600	1,152,228.00	0.14
314	300676	华大基因	25,300	1,147,608.00	0.14

315	600008	首创环保	381,110	1,143,330.00	0.14
316	603939	益丰药房	52,372	1,137,519.84	0.14
317	002984	森麒麟	53,600	1,134,712.00	0.14
318	600329	达仁堂	24,700	1,126,814.00	0.14
319	603885	吉祥航空	75,600	1,124,928.00	0.14
320	002432	九安医疗	28,000	1,121,120.00	0.14
321	601991	大唐发电	321,000	1,120,290.00	0.14
322	600282	南钢股份	212,900	1,119,854.00	0.14
323	688278	特宝生物	13,361	1,118,048.48	0.14
324	002500	山西证券	185,930	1,113,720.70	0.14
325	600998	九州通	217,489	1,113,543.68	0.14
326	300144	宋城演艺	135,800	1,112,202.00	0.14
327	600132	重庆啤酒	21,100	1,102,264.00	0.13
328	600380	健康元	95,300	1,100,715.00	0.13
329	688582	芯动联科	16,600	1,097,426.00	0.13
330	600095	湘财股份	99,100	1,096,046.00	0.13
331	601155	新城控股	78,100	1,089,495.00	0.13
332	600763	通策医疗	26,984	1,085,026.64	0.13
333	002244	滨江集团	107,400	1,079,370.00	0.13
334	600390	五矿资本	193,800	1,075,590.00	0.13
335	002312	川发龙蟒	98,300	1,074,419.00	0.13
336	002583	海能达	94,800	1,073,136.00	0.13
337	603589	口子窖	35,700	1,072,785.00	0.13
338	000513	丽珠集团	31,100	1,071,706.00	0.13
339	688301	奕瑞科技	10,475	1,059,127.25	0.13
340	000987	越秀资本	130,090	1,058,932.60	0.13
341	000591	太阳能	236,900	1,051,836.00	0.13
342	300146	汤臣倍健	87,300	1,048,473.00	0.13
343	600583	海油工程	190,700	1,046,943.00	0.13
344	601608	中信重工	158,200	1,042,538.00	0.13
345	600985	淮北矿业	93,600	1,039,896.00	0.13
346	601865	福莱特	66,300	1,038,921.00	0.13
347	600995	南网储能	82,600	1,038,282.00	0.13
348	600602	云赛智联	55,500	1,037,295.00	0.13
349	300558	贝达药业	22,000	1,027,180.00	0.13
350	603225	新凤鸣	52,700	1,025,542.00	0.13
351	601880	辽港股份	636,000	1,017,600.00	0.12
352	688728	格科微	67,956	1,015,262.64	0.12
353	601156	东航物流	54,800	1,008,868.00	0.12
354	600754	锦江酒店	39,900	1,008,273.00	0.12
355	601666	平煤股份	128,100	1,008,147.00	0.12
356	600977	中国电影	64,000	1,006,080.00	0.12
357	000921	海信家电	40,500	1,004,805.00	0.12

358	300735	光弘科技	40,400	1,004,344.00	0.12
359	600685	中船防务	35,100	998,595.00	0.12
360	002568	百润股份	45,600	994,536.00	0.12
361	601016	节能风电	333,890	984,975.50	0.12
362	601000	唐山港	256,300	984,192.00	0.12
363	003021	兆威机电	7,900	981,022.00	0.12
364	600004	白云机场	102,400	968,704.00	0.12
365	000825	太钢不锈	197,400	965,286.00	0.12
366	600848	上海临港	82,500	965,250.00	0.12
367	600535	天士力	64,000	964,480.00	0.12
368	600816	建元信托	340,200	962,766.00	0.12
369	603927	中科软	50,316	960,532.44	0.12
370	601001	晋控煤业	72,600	954,690.00	0.12
371	000032	深桑达 A	49,300	953,955.00	0.12
372	603290	斯达半导	9,900	951,291.00	0.12
373	603650	彤程新材	21,500	949,010.00	0.12
374	600126	杭钢股份	116,200	948,192.00	0.12
375	002773	康弘药业	31,600	947,052.00	0.12
376	002266	浙富控股	225,930	939,868.80	0.12
377	002423	中粮资本	79,600	931,320.00	0.11
378	600511	国药股份	32,300	928,625.00	0.11
379	000598	兴蓉环境	129,000	924,930.00	0.11
380	603000	人民网	48,000	914,400.00	0.11
381	000563	陕国投 A	265,000	914,250.00	0.11
382	600483	福能股份	96,500	913,855.00	0.11
383	600598	北大荒	61,000	911,950.00	0.11
384	601966	玲珑轮胎	62,700	911,031.00	0.11
385	301536	星宸科技	15,100	904,641.00	0.11
386	002831	裕同科技	31,600	900,916.00	0.11
387	000958	电投产融	139,100	899,977.00	0.11
388	600517	国网英大	148,600	893,086.00	0.11
389	601333	广深铁路	292,800	890,112.00	0.11
390	600578	京能电力	174,000	887,400.00	0.11
391	600739	辽宁成大	79,300	886,574.00	0.11
392	002299	圣农发展	53,600	886,544.00	0.11
393	601918	新集能源	134,100	886,401.00	0.11
394	688561	奇安信	24,900	885,942.00	0.11
395	002439	启明星辰	62,300	879,676.00	0.11
396	000062	深圳华强	35,700	878,934.00	0.11
397	600808	马钢股份	206,400	871,008.00	0.11
398	603341	龙旗科技	20,600	870,556.00	0.11
399	601118	海南橡胶	148,300	867,555.00	0.11
400	600546	山煤国际	85,300	860,677.00	0.11

401	600655	豫园股份	167,700	860,301.00	0.11
402	603688	石英股份	23,500	859,630.00	0.11
403	000951	中国重汽	50,800	858,520.00	0.11
404	603899	晨光股份	31,600	855,096.00	0.10
405	300601	康泰生物	57,600	850,752.00	0.10
406	601866	中远海发	337,200	849,744.00	0.10
407	603833	欧派家居	16,300	849,067.00	0.10
408	002670	国盛证券	50,300	847,052.00	0.10
409	002120	韵达股份	125,500	845,870.00	0.10
410	300718	长盛轴承	9,900	845,064.00	0.10
411	600131	国网信通	51,800	836,052.00	0.10
412	688318	财富趋势	6,300	833,616.00	0.10
413	000883	湖北能源	183,500	833,090.00	0.10
414	600566	济川药业	31,600	831,080.00	0.10
415	600582	天地科技	142,500	830,775.00	0.10
416	688281	华秦科技	11,223	828,257.40	0.10
417	000709	河钢股份	357,700	826,287.00	0.10
418	300529	健帆生物	41,900	824,173.00	0.10
419	000739	普洛药业	50,200	816,754.00	0.10
420	601598	中国外运	133,700	810,222.00	0.10
421	600663	陆家嘴	102,100	807,611.00	0.10
422	600707	彩虹股份	124,300	806,707.00	0.10
423	000027	深圳能源	123,700	806,524.00	0.10
424	000967	盈峰环境	109,200	801,528.00	0.10
425	002508	老板电器	41,400	801,090.00	0.10
426	000088	盐田港	179,900	800,555.00	0.10
427	600528	中铁工业	96,400	788,552.00	0.10
428	603786	科博达	10,000	781,000.00	0.10
429	300888	稳健医疗	20,380	771,179.20	0.09
430	002153	石基信息	71,140	770,446.20	0.09
431	000582	北部湾港	81,700	766,346.00	0.09
432	600871	石化油服	350,700	757,512.00	0.09
433	688172	燕东微	25,900	749,546.00	0.09
434	600906	财达证券	111,800	745,706.00	0.09
435	600959	江苏有线	215,700	742,008.00	0.09
436	300957	贝泰妮	18,700	740,707.00	0.09
437	300070	碧水源	187,700	735,784.00	0.09
438	603565	中谷物流	72,900	731,916.00	0.09
439	688709	成都华微	15,800	726,642.00	0.09
440	603858	步长制药	45,900	717,876.00	0.09
441	002265	建设工业	26,700	716,094.00	0.09
442	603233	大参林	39,910	703,214.20	0.09
443	688425	铁建重工	137,900	699,153.00	0.09

444	688363	华熙生物	15,900	694,512.00	0.09
445	601098	中南传媒	61,600	693,616.00	0.08
446	003022	联泓新科	34,200	677,502.00	0.08
447	600968	海油发展	176,000	675,840.00	0.08
448	603529	爱玛科技	22,700	674,190.00	0.08
449	601061	中信金属	46,800	673,920.00	0.08
450	600764	中国海防	24,600	672,564.00	0.08
451	601928	凤凰传媒	66,500	667,660.00	0.08
452	688192	迪哲医药	11,400	656,640.00	0.08
453	000959	首钢股份	133,900	656,110.00	0.08
454	600062	华润双鹤	35,490	649,112.10	0.08
455	688563	航材股份	11,100	648,795.00	0.08
456	301498	乖宝宠物	9,900	644,985.00	0.08
457	002032	苏泊尔	14,400	634,752.00	0.08
458	600295	鄂尔多斯	51,300	634,068.00	0.08
459	301200	大族数控	5,300	629,481.00	0.08
460	000785	居然智家	214,900	627,508.00	0.08
461	688248	南网科技	13,999	626,315.26	0.08
462	688336	三生国健	10,200	607,614.00	0.07
463	600606	绿地控股	364,400	604,904.00	0.07
464	001286	陕西能源	64,200	597,702.00	0.07
465	600098	广州发展	90,300	590,562.00	0.07
466	000537	绿发电力	71,800	589,478.00	0.07
467	301301	川宁生物	57,600	584,064.00	0.07
468	688349	三一重能	22,653	572,667.84	0.07
469	002372	伟星新材	54,900	572,607.00	0.07
470	600720	中交设计	79,300	572,546.00	0.07
471	601965	中国汽研	34,300	569,380.00	0.07
472	603658	安图生物	15,300	541,926.00	0.07
473	000429	粤高速 A	45,500	535,990.00	0.07
474	600688	上海石化	189,700	527,366.00	0.06
475	000898	鞍钢股份	206,400	522,192.00	0.06
476	000937	冀中能源	92,200	496,036.00	0.06
477	601139	深圳燃气	74,700	493,020.00	0.06
478	002608	江苏国信	65,900	487,001.00	0.06
479	688295	中复神鹰	14,838	486,834.78	0.06
480	600339	中油工程	145,300	486,755.00	0.06
481	688100	威胜信息	12,200	479,460.00	0.06
482	688520	神州细胞	11,001	476,453.31	0.06
483	601019	山东出版	54,000	466,560.00	0.06
484	600032	浙江新能	61,914	458,782.74	0.06
485	003035	南网能源	98,500	451,130.00	0.06
486	601228	广州港	130,400	422,496.00	0.05

487	600927	永安期货	25,200	404,964.00	0.05
488	603049	中策橡胶	7,200	402,840.00	0.05
489	688475	萤石网络	13,000	391,430.00	0.05
490	603707	健友股份	42,361	382,519.83	0.05
491	688819	天能股份	11,200	372,064.00	0.05
492	300140	节能环保	53,500	362,195.00	0.04
493	002945	华林证券	23,500	360,255.00	0.04
494	600007	中国国贸	17,800	352,796.00	0.04
495	002461	珠江啤酒	37,700	350,233.00	0.04
496	000539	粤电力 A	77,000	340,340.00	0.04
497	001213	中铁特货	76,900	311,445.00	0.04
498	600299	安迪苏	34,400	308,568.00	0.04
499	601921	浙版传媒	37,800	295,596.00	0.04
500	001221	悍高集团	3,000	173,730.00	0.02

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	400174	中天 3	44,600	0.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300476	胜宏科技	12,262,783.00	13.78
2	300450	先导智能	6,190,625.39	6.96
3	000988	华工科技	5,650,166.00	6.35
4	002558	巨人网络	5,413,512.00	6.08
5	300339	润和软件	4,814,327.91	5.41
6	002837	英维克	4,666,191.00	5.24
7	002850	科达利	4,630,993.00	5.21
8	300857	协创数据	4,431,576.00	4.98
9	002156	通富微电	4,319,129.00	4.85
10	300207	欣旺达	4,250,955.00	4.78
11	000426	兴业银锡	4,114,148.00	4.62
12	002517	恺英网络	4,034,025.84	4.53
13	002195	岩山科技	3,964,420.00	4.46
14	002261	拓维信息	3,896,315.00	4.38
15	002340	格林美	3,812,291.00	4.28
16	301308	江波龙	3,795,294.00	4.27
17	002281	光迅科技	3,654,195.00	4.11
18	000933	神火股份	3,616,247.00	4.06
19	300803	指南针	3,609,492.00	4.06

20	002738	中矿资源	3,594,518.00	4.04
21	002966	苏州银行	3,568,110.00	4.01
22	002202	金风科技	3,563,338.08	4.01
23	002273	水晶光电	3,537,611.00	3.98
24	002436	兴森科技	3,532,258.00	3.97
25	002402	和而泰	3,521,730.00	3.96
26	300454	深信服	3,497,536.00	3.93
27	002130	沃尔核材	3,412,145.00	3.84
28	300115	长盈精密	3,389,724.00	3.81
29	000831	中国稀土	3,307,601.00	3.72
30	002008	大族激光	3,294,752.00	3.70
31	002532	天山铝业	3,277,170.00	3.68
32	301358	湖南裕能	3,256,318.12	3.66
33	300604	长川科技	3,224,214.00	3.62
34	002851	麦格米特	3,205,336.00	3.60
35	002353	杰瑞股份	3,199,832.00	3.60
36	688347	华虹公司	3,149,683.56	3.54
37	002294	信立泰	3,122,378.00	3.51
38	300395	菲利华	3,074,373.00	3.46
39	002131	利欧股份	3,024,325.00	3.40
40	002138	顺络电子	3,013,939.94	3.39
41	002797	第一创业	2,968,087.00	3.34
42	300136	信维通信	2,962,591.00	3.33
43	300054	鼎龙股份	2,952,120.00	3.32
44	002821	凯莱英	2,887,327.00	3.25
45	002128	电投能源	2,868,853.00	3.22
46	000021	深科技	2,863,832.00	3.22
47	300458	全志科技	2,816,789.50	3.17
48	300037	新宙邦	2,761,105.00	3.10
49	002185	华天科技	2,755,623.00	3.10
50	002126	银轮股份	2,735,465.00	3.07
51	300346	南大光电	2,726,886.01	3.06
52	300223	北京君正	2,716,590.00	3.05
53	002472	双环传动	2,700,108.00	3.03
54	688235	百济神州	2,678,661.31	3.01
55	300724	捷佳伟创	2,606,472.00	2.93
56	300474	景嘉微	2,588,829.00	2.91
57	000783	长江证券	2,568,587.00	2.89
58	002465	海格通信	2,567,749.00	2.89
59	600601	方正科技	2,565,626.00	2.88
60	300058	蓝色光标	2,531,872.00	2.85
61	300017	网宿科技	2,530,310.00	2.84
62	000423	东阿阿胶	2,505,902.00	2.82

63	300002	神州泰岳	2,501,714.00	2.81
64	300919	中伟新材	2,488,908.00	2.80
65	688608	恒玄科技	2,481,944.84	2.79
66	002078	太阳纸业	2,480,436.00	2.79
67	002085	万丰奥威	2,431,560.90	2.73
68	000878	云南铜业	2,423,257.00	2.72
69	002155	湖南黄金	2,405,380.00	2.70
70	000034	神州数码	2,394,248.00	2.69
71	002624	完美世界	2,386,462.00	2.68
72	002157	正邦科技	2,383,790.00	2.68
73	002595	豪迈科技	2,347,696.12	2.64
74	300751	迈为股份	2,345,285.52	2.64
75	002683	广东宏大	2,314,870.00	2.60
76	300073	当升科技	2,312,010.00	2.60
77	000893	亚钾国际	2,310,653.00	2.60
78	300496	中科创达	2,286,833.00	2.57
79	300012	华测检测	2,284,587.00	2.57
80	002410	广联达	2,284,172.00	2.57
81	002271	东方雨虹	2,277,789.00	2.56
82	000066	中国长城	2,270,223.00	2.55
83	000932	华菱钢铁	2,239,494.00	2.52
84	000728	国元证券	2,228,652.00	2.50
85	300748	金力永磁	2,223,236.00	2.50
86	300763	锦浪科技	2,196,186.00	2.47
87	300677	英科医疗	2,183,966.61	2.45
88	002414	高德红外	2,171,852.00	2.44
89	300024	机器人	2,156,279.00	2.42
90	300567	精测电子	2,151,213.00	2.42
91	002673	西部证券	2,134,911.00	2.40
92	000960	锡业股份	2,115,119.00	2.38
93	300570	太辰光	2,107,802.06	2.37
94	002223	鱼跃医疗	2,102,498.00	2.36
95	688072	拓荆科技	2,101,886.62	2.36
96	000657	中钨高新	2,099,015.14	2.36
97	002065	东华软件	2,093,846.00	2.35
98	300627	华测导航	2,090,987.00	2.35
99	603129	春风动力	2,086,891.00	2.35
100	688027	国盾量子	2,070,801.06	2.33
101	002080	中材科技	2,065,588.00	2.32
102	300003	乐普医疗	2,057,937.00	2.31
103	002444	巨星科技	2,057,013.00	2.31
104	300373	扬杰科技	2,056,820.00	2.31
105	002409	雅克科技	2,017,099.00	2.27

106	002007	华兰生物	1,993,317.50	2.24
107	300285	国瓷材料	1,981,945.00	2.23
108	688019	安集科技	1,954,898.26	2.20
109	300251	光线传媒	1,952,768.00	2.19
110	300383	光环新网	1,951,033.00	2.19
111	300390	天华新能	1,925,227.00	2.16
112	000887	中鼎股份	1,923,441.00	2.16
113	001696	宗申动力	1,893,856.00	2.13
114	000750	国海证券	1,882,501.00	2.12
115	300757	罗博特科	1,880,546.00	2.11
116	000528	柳 工	1,869,625.00	2.10
117	002064	华峰化学	1,828,408.00	2.06
118	000009	中国宝安	1,822,151.00	2.05
119	301536	星辰科技	1,818,411.00	2.04
120	300623	捷捷微电	1,817,114.00	2.04
121	002335	科华数据	1,798,274.00	2.02
122	000997	新 大 陆	1,788,738.00	2.01

注：本项“买入金额”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。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300476	胜宏科技	14,875,754.00	16.72
2	000988	华工科技	6,503,483.00	7.31
3	688521	芯原股份	5,974,365.61	6.71
4	603893	瑞芯微	3,810,503.00	4.28
5	300803	指南针	3,787,088.55	4.26
6	688072	拓荆科技	3,326,807.56	3.74
7	600895	张江高科	2,564,912.00	2.88
8	600839	四川长虹	2,372,971.00	2.67
9	000066	中国长城	2,354,869.00	2.65
10	002850	科达利	2,211,356.00	2.49
11	300251	光线传媒	2,172,705.00	2.44
12	688120	华海清科	2,109,559.84	2.37
13	688249	晶合集成	2,101,356.29	2.36
14	688525	佰维存储	2,094,677.35	2.35
15	688099	晶晨股份	1,795,258.45	2.02
16	300573	兴齐眼药	1,696,088.00	1.91
17	601933	永辉超市	1,653,418.00	1.86
18	002653	海思科	1,536,294.00	1.73
19	300450	先导智能	1,490,634.00	1.68
20	300857	协创数据	1,411,258.00	1.59

注：本项“卖出金额”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。

8.4.3 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	576,651,004.31
卖出股票收入（成交）总额	223,410,209.12

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	82,001.26	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	82,001.26	0.01

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	118063	金 05 转债	820	82,001.26	0.01

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

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时，将严格根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等。股指期货的投资主要采用流动性好、交易活跃的合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作，力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频

繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

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

本基金投资范围未包括国债期货，无相关投资政策。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金投资范围未包括国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体在报告编制日前一年内受到处罚如下：

赤峰吉隆黄金矿业股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国证券监督管理委员会内蒙古监管局的行政监督管理措施。

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、基金合同及公司投资制度的要求。

本基金投资的前十名证券的其他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以内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，不存在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	122,014.54
2	应收清算款	13,463,626.27
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	13,585,640.81

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

注：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的股票。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	400174	中天 3	0.00	0.00	暂停转让

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，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

9.1.1 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（%）
1,239	424,104.99	456,249,280.00	86.83	69,216,800.00	13.17

9.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例（%）
联接基金	401,254,680.00	76.36

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	华泰证券股份有限公司	34,000,000.00	6.47
2	新华人寿保险股份有限公司	7,218,800.00	1.37
3	万家基金—交通银行—万家基金建信人寿资产管理计划	3,800,000.00	0.72
4	西部利得基金—西部证券股份有限公司—西部利得信泉 2 号单一资产管理计划	3,248,200.00	0.62
5	中国光大银行股份有	2,916,200.00	0.55

	限公司—光大保德信阳光三个月持有期混合型基金中基金（FOF）		
6	高仲远	1,869,100.00	0.36
7	中信建投证券股份有限公司	1,605,900.00	0.31
8	陈月英	1,109,400.00	0.21
9	杨英英	1,047,000.00	0.20
10	冯刚雄	1,000,000.00	0.19
10	毛桂嫦	1,000,000.00	0.19
10	广州市壹方私募基金管理有限公司—壹方学海无涯私募证券投资基金	1,000,000.00	0.19
11	招商银行股份有限公司—中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	401,254,680.00	76.36

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本基金本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

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情况

注：本基金本报告期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理均未持有本基金。

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

注：无

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020 年 4 月 30 日）基金份额总额	251,466,080.00
本报告期期初基金份额总额	75,466,080.00
本报告期基金总申购份额	560,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	110,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	525,466,080.00

§ 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

2025 年 6 月 9 日，公司聘任盖文国兼任公司合规总监、公募基金管理业务合规负责人，公司执行总裁周冰不再代为履行合规总监兼公募基金管理业务合规负责人职责；赵青伟先生自 2025 年 6 月 27 日起不再担任公司资管总监。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

一、本报告期内，本基金管理人无涉及基金管理业务的诉讼，公司其他主要诉讼、仲裁事项请参见《中银国际证券股份有限公司 2025 年年度报告》；

二、本报告期内，无涉及基金财产的诉讼事项；

三、本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。本基金本年度应支付给审计机构毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为 23,850.00 元人民币，其已提供审计服务的连续年限为 2 年。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，公募基金业务未有管理人受调查或处罚等情况。

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，公募基金业务未有相关从业人员受调查或处罚等情况。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，未有托管人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

注：本报告期内，未有托管人相关从业人员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 (%)	
中银证券	6	800,061,213.43	100.00	156,743.95	100.00	-

注：1、由于交易所系统限制，本基金管理人作为上海、深圳和北京证券交易所的会员单位目前尚不能再租用其他证券公司的交易单元。

2、今后基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

3、今后基金专用交易席位的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构。
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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 (%)
中银证券	254,844.75	100.00	-	-	-	-

注：1、由于交易所系统限制，本基金管理人作为上海、深圳和北京证券交易所的会员单位目前尚不能再租用其他证券公司的交易单元。

2、今后基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1)经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3)具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

3、今后基金专用交易席位的选择程序如下：

- (1)本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构。
- (2)基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

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	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第四季度报告	上交所、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 1 月 22 日
2	中银国际证券股份有限公司旗下基金 2024 年第 4 季度报告提示性公告	规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 1 月 22 日
3	中银国际证券股份有限公司关于调整旗下基金停牌股票估值方法的公告	规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 2 月 8 日
4	关于中银国际证券股份有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	上交所、深交所、规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 3 月 20 日
5	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同	上交所、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 3 月 20 日
6	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书（2025 年第 1 号）	上交所、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 3 月 20 日
7	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	上交所、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 3 月 20 日
8	中银国际证券股份有限公司旗下公募基金通过证券公司交易及佣金支付情况公告	规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 3 月 28 日
9	中银国际证券股份有限公司旗下基金 2024 年年度报告提示性公告	规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 3 月 28 日

		露网站	
10	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年年度报告	上交所、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 3 月 28 日
11	中银国际证券股份有限公司旗下基金 2025 年第 1 季度报告提示性公告	规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 4 月 19 日
12	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第一季度报告	上交所、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 4 月 19 日
13	中银国际证券股份有限公司关于高级管理人员变更的公告	上交所、深交所、规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 6 月 10 日
14	中银国际证券股份有限公司关于旗下交易型开放式指数证券投资基金新增广发证券为申购赎回代理券商的公告	上交所、深交所、规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 6 月 16 日
15	中银国际证券股份有限公司关于董事长变更及执行总裁代为履行董事长职务的公告	上交所、深交所、规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 6 月 25 日
16	中银国际证券股份有限公司关于高级管理人员变更的公告	上交所、深交所、规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 6 月 28 日
17	中银国际证券股份有限公司关于中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金投资关联方证券的公告	上交所、规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 7 月 14 日
18	中银国际证券股份有限公司关于旗下中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金新增国泰海通证券为申购赎回代理券商的公告	上交所、规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 7 月 18 日
19	中银国际证券股份有限公司旗下基金 2025 年第 2 季度报告提示性公告	规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 7 月 19 日
20	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第二季度报告	上交所、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 7 月 19 日
21	中银国际证券股份有限公司关于中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更的公告	上交所、规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 8 月 19 日
22	中银证券中证 500 交易型开放式指数	上交所、公司官网及中	2025 年 8 月 21 日

	证券投资基金招募说明书更新（2025 年第 2 号）	国证监会基金电子披露网站	
23	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	上交所、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 8 月 21 日
24	中银国际证券股份有限公司关于调整旗下基金停牌股票估值方法的公告	规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 8 月 29 日
25	中银国际证券股份有限公司旗下基金 2025 年中期报告提示性公告	规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 8 月 30 日
26	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年中期报告	上交所、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 8 月 30 日
27	中银国际证券股份有限公司关于调整旗下基金停牌股票估值方法的公告	规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 9 月 4 日
28	中银国际证券股份有限公司关于中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更的公告	上交所、规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 9 月 5 日
29	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书更新（2025 年第 3 号）	上交所、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 9 月 6 日
30	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	上交所、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 9 月 6 日
31	中银国际证券股份有限公司关于董事长变更的公告	上交所、深交所、规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 9 月 6 日
32	中银国际证券股份有限公司旗下基金 2025 年第 3 季度报告提示性公告	规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 10 月 25 日
33	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第三季度报告	上交所、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 10 月 25 日
34	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书更新	上交所、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 12 月 30 日

§ 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	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
-----	----------------	------------

类别	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	20250101-20251231	63,932,680.00	380,069,600.00	42,747,600.00	401,254,680.00	76.36
产品特有风险							
本基金由于存在单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况，如遇市场行情突变可能存在大额赎回甚至巨额赎回的风险，增加基金管理人的流动性管理压力。同时，基金管理人应付赎回的变现行为可能使基金资产净值受到不利影响或者产生较大波动。本基金管理人后期将审慎评估大额申购对基金持有集中度的影响，避免单一投资者集中度继续提高，同时将完善流动性风险风险管控机制，加强对基金持有人利益的保护。							

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、中国证监会准予本基金募集注册的文件
- 2、基金合同
- 3、托管协议
- 4、法律意见书
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 7、中国证监会要求的其他文件

13.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所。

13.3 查阅方式

投资者可以在开放时间内至基金管理人或基金托管人住所免费查阅，也可登陆基金管理人基金网站 www.bocifunds.com 查阅。

中银国际证券股份有限公司
2026 年 3 月 31 日