

永赢中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人：永赢基金管理有限公司

基金托管人：中信证券股份有限公司

送出日期：2026 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	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	主要财务指标和基金净值表现	6
3.1	主要会计数据和财务指标	6
3.2	基金净值表现	6
§ 4	管理人报告	7
4.1	基金管理人及基金经理情况	7
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5	托管人报告	14
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1	资产负债表	15
6.2	利润表	16
6.3	净资产变动表	17
6.4	报表附注	18
§ 7	投资组合报告	37
7.1	期末基金资产组合情况	37
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	38
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	39
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	52
7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	53
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	53
7.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	53
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	53
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	53
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53

7.12	投资组合报告附注	53
§ 8	基金份额持有人信息	54
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2	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	54
§ 9	开放式基金份额变动	55
§ 10	重大事件揭示	55
10.1	基金份额持有人大会决议	55
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	55
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4	基金投资策略的改变	55
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	55
10.6	管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	55
10.7	基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	57
10.8	其他重大事件	57
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	59
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	59
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	59
§ 12	备查文件目录	59
12.1	备查文件目录	59
12.2	存放地点	60
12.3	查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	永赢中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	A500ETF 永赢
场内简称	A500 永赢、A500ETF 永赢
基金主代码	159386
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 01 月 24 日
基金管理人	永赢基金管理有限公司
基金托管人	中信证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	57,869,559.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2025 年 02 月 11 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。
投资策略	本基金主要采用完全复制法进行投资，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。主要投资策略有：股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略和存托凭证投资策略。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，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		永赢基金管理有限公司	中信证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	汪成杰	杨军智
	联系电话	021-20430340	010-60834299
	电子邮箱	wangcj@maxwealthfund.com	yjz@citics.com
客户服务电话		400-805-8888	010-60836588
传真		021-51690177	010-60834004
注册地址		浙江省宁波市鄞州区中山东路 466 号	广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座
办公地址		上海市浦东新区世纪大道 210 号二十一世纪大厦 21、22、23、27	北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 5 层

	层	
邮政编码	200120	100125
法定代表人	马宇晖	张佑君

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.maxwealthfund.com
基金中期报告置备地点	上海市浦东新区世纪大道 210 号二十一世纪大厦 21、22、23、27 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）
本期已实现收益	24,889,441.88
本期利润	16,278,421.52
加权平均基金份额本期利润	0.1466
本期加权平均净值利润率	11.11%
本期基金份额净值增长率	12.41%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）
期末可供分配利润	24,141,426.59
期末可供分配基金份额利润	0.4172
期末基金资产净值	82,010,985.59
期末基金份额净值	1.4172
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	41.72%

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

2、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、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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	14.73%	1.40%	14.26%	1.41%	0.47%	-0.01%
过去六个月	12.41%	1.28%	11.91%	1.29%	0.50%	-0.01%
过去一年	39.28%	1.14%	36.38%	1.14%	2.90%	0.00%
自基金合同生 效起至今	41.72%	1.12%	41.47%	1.13%	0.25%	-0.01%

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

永赢中证A500交易型开放式指数证券投资基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2025年01月24日-2026年06月30日)



注：本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

§ 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

永赢基金管理有限公司（以下简称“公司”）于 2013 年 10 月 8 日取得了中国证监会《关于核准设立永赢基金管理有限公司的批复》（证监许可[2013]1280 号），随后，公司于 2013 年 10 月 11 日取得商务部《中华人民共和国外商投资企业批准证书》（商外资资审字[2013]008 号），并于 2013 年 11 月 7 日在国家工商行政管理总局注册成立，此后，于 2013 年 11 月 12 日取得中国证监会核发的《基金管理资格证书》（编号 A087），并于 2017 年 3 月 14 日获得中国证监会颁发的信用代码为

913302007178854322 的《中华人民共和国经营证券期货业务许可证》。2014 年 8 月 18 日，公司完成工商变更登记，注册资本由人民币壹点伍亿元增至人民币贰亿元；2018 年 1 月 25 日，公司完成增资，注册资本由人民币贰亿元增至人民币玖亿元。目前，公司的股权结构为：宁波银行股份有限公司出资占比 71.49%，Oversea-Chinese Banking Corporation Limited 出资占比 25%，上海稳进同赢企业管理中心（有限合伙）出资占比 1.1739%，上海锐进同赢企业管理中心（有限合伙）出资占比 1.1696%，上海聚信同赢企业管理中心（有限合伙）出资占比 1.1665%。

截止 2026 年 06 月 30 日，本基金管理人共管理 199 只开放式证券投资基金，即永赢货币市场基金、永赢稳益债券型证券投资基金、永赢双利债券型证券投资基金、永赢丰益债券型证券投资基金、永赢添益债券型证券投资基金、永赢瑞益债券型证券投资基金、永赢天天利货币市场基金、永赢永益债券型证券投资基金、永赢丰利债券型证券投资基金、永赢增益债券型证券投资基金、永赢恒益债券型证券投资基金、永赢惠添利灵活配置混合型证券投资基金、永赢惠益债券型证券投资基金、永赢泰益债券型证券投资基金、永赢润益债券型证券投资基金、永赢聚益债券型证券投资基金、永赢盈益债券型证券投资基金、永赢荣益债券型证券投资基金、永赢盛益债券型证券投资基金、永赢嘉益债券型证券投资基金、永赢裕益债券型证券投资基金、永赢祥益债券型证券投资基金、永赢通益债券型证券投资基金、永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金、永赢诚益债券型证券投资基金、永赢昌益债券型证券投资基金、永赢宏益债券型证券投资基金、永赢伟益债券型证券投资基金、永赢颐利债券型证券投资基金、永赢迅利中高等级短债债券型证券投资基金、永赢合益债券型证券投资基金、永赢中债-1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、永赢智能领先混合型证券投资基金、永赢泰利债券型证券投资基金、永赢悦利债券型证券投资基金、永赢卓利债券型证券投资基金、永赢凯利债券型证券投资基金、永赢惠泽一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、永赢智益纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、永赢沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、永赢众利债券型证券投资基金、永赢同利债券型证券投资基金、永赢昌利债券型证券投资基金、永赢开泰中高等级中短债债券型证券投资基金、永赢创业板指数型发起式证券投资基金、永赢汇利六个月定期开放债券型证券投资基金、永赢淳利债券型证券投资基金、永赢高端制造混合型证券投资基金、永赢久利债券型证券投资基金、永赢乾元三年定期开放混合型证券投资基金、永赢科技驱动混合型证券投资基金、永赢元利债券型证券投资基金、永赢易弘债券型证券投资基金、永赢股息优选混合型证券投资基金、永赢中债-1-5 年国开行债券指数证券投资基金、永赢医药健康股票型证券投资基金、永赢邦利债券型证券投资基金、永赢瑞宁 87 个月定期开放债券型证券投资基金、永赢欣益纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、永赢稳健增长一年持有期混合型证券投资基金、永赢泽利一年定期开放债券型证券投资基金、永赢鑫享混合型证券投资基金、永

赢鼎利债券型证券投资基金、永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金、永赢成长领航混合型证券投资基金、永赢泰宁 63 个月定期开放债券型证券投资基金、永赢鑫欣混合型证券投资基金、永赢稳健增利 18 个月持有期混合型证券投资基金、永赢鑫盛混合型证券投资基金、永赢宏泽一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、永赢惠添益混合型证券投资基金、永赢中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金、永赢华嘉信用债债券型证券投资基金、永赢港股通优质成长一年持有期混合型证券投资基金、永赢深证 100 交易型开放式指数证券投资基金、永赢乾益债券型证券投资基金、永赢鑫辰混合型证券投资基金、永赢中债-3-5 年政策性金融债指数证券投资基金、永赢长远价值混合型证券投资基金、永赢信利碳中和主题一年定期开放债券型发起式证券投资基金、永赢惠添盈一年持有期混合型证券投资基金、永赢中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、永赢轩益债券型证券投资基金、永赢合享混合型发起式证券投资基金、永赢慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF）、永赢安盈 90 天滚动持有债券型发起式证券投资基金、永赢稳健增强债券型证券投资基金、永赢添添欣 12 个月持有期混合型证券投资基金、永赢成长远航一年持有期混合型证券投资基金、永赢新能源智选混合型发起式证券投资基金、永赢坤益债券型证券投资基金、永赢高端装备智选混合型发起式证券投资基金、永赢宏泰短债债券型证券投资基金、永赢添添悦 6 个月持有期混合型证券投资基金、永赢优质生活混合型证券投资基金、永赢安悦 60 天持有期中短债债券型证券投资基金、永赢湖北国有企业债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、永赢中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、永赢半导体产业智选混合型发起式证券投资基金、永赢低碳环保智选混合型发起式证券投资基金、永赢安泰中短债债券型证券投资基金、永赢医药创新智选混合型发起式证券投资基金、永赢消费鑫选 6 个月持有期混合型证券投资基金、永赢新兴消费智选混合型发起式证券投资基金、永赢消费龙头智选混合型发起式证券投资基金、永赢合嘉一年持有期混合型证券投资基金、永赢季季享 90 天持有期中短债债券型证券投资基金、永赢昭利债券型证券投资基金、永赢恒欣稳健养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、永赢数字经济智选混合型发起式证券投资基金、永赢月月享 30 天持有期短债债券型证券投资基金、永赢先进制造智选混合型发起式证券投资基金、永赢浩益一年定期开放债券型发起式证券投资基金、永赢匠心增利债券型证券投资基金、永赢启源混合型发起式证券投资基金、永赢中证沪深港黄金产业股票交易型开放式指数证券投资基金、永赢睿信混合型证券投资基金、永赢中证沪深港黄金产业股票交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、永赢腾利债券型证券投资基金、永赢红利慧选混合型发起式证券投资基金、永赢瑞弘 12 个月持有期债券型证券投资基金、永赢璟利债券型证券投资基金、永赢安裕 120 天滚动持有债券型证券投资基金、永赢悦享债券型证券投资基金、永赢上证科创板 100 指数增强型发起式证券投资基金、永赢启鑫混合型证券投资基金、永赢安怡 30 天持有期债券型证券

投资基金、永赢安源 60 天滚动持有债券型证券投资基金、永赢逸享债券型证券投资基金、永赢融安混合型证券投资基金、永赢汇享债券型证券投资基金、永赢科技智选混合型发起式证券投资基金、永赢沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、永赢安泽 6 个月持有期债券型证券投资基金、永赢睿恒混合型证券投资基金、永赢中证 A50 指数增强型发起式证券投资基金、永赢安和 30 天持有期债券型证券投资基金、永赢国证通用航空产业交易型开放式指数证券投资基金、永赢锐见进取混合型证券投资基金、永赢中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金、永赢国证商用卫星通信产业交易型开放式指数证券投资基金、永赢国证通用航空产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、永赢中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、永赢多元增利债券型证券投资基金、永赢信息产业智选混合型发起式证券投资基金、永赢中证港股通医疗主题交易型开放式指数证券投资基金、永赢北证 50 成份指数型发起式证券投资基金、永赢价值发现慧选混合型发起式证券投资基金、永赢中证 A500 指数增强型证券投资基金、永赢上证科创板综合价格指数型证券投资基金、永赢制造升级智选混合型发起式证券投资基金、永赢上证科创板 50 成份指数型证券投资基金、永赢国证自由现金流交易型开放式指数证券投资基金、永赢中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、永赢上证科创板综合价格增强策略交易型开放式指数证券投资基金、永赢国证商用卫星通信产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、永赢汇达 6 个月持有期混合型证券投资基金、永赢恒生消费指数型发起式证券投资基金（QDII）、永赢中证港股通央企红利交易型开放式指数证券投资基金、永赢新材料智选混合型发起式证券投资基金、永赢港股通科技智选混合型发起式证券投资基金、永赢国企机遇慧选混合型发起式证券投资基金、永赢泓利债券型证券投资基金、永赢元盈稳健多资产 90 天持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、永赢上证科创板人工智能指数型发起式证券投资基金、永赢中债-优选投资级信用债（1-3 年）指数证券投资基金、永赢资源慧选混合型发起式证券投资基金、永赢中证港股通医疗主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、永赢中证港股通央企红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、永赢锐见先锋混合型证券投资基金、永赢先锋半导体智选混合型发起式证券投资基金、永赢新兴产业智选混合型发起式证券投资基金、永赢国证自由现金流交易型开放式指数证券投资基金联接基金、永赢上证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金、永赢中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金、永赢元享稳健多资产 90 天持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、永赢沪深 300 指数增强型证券投资基金、永赢价值回报混合型证券投资基金、永赢中证家电家居交易型开放式指数证券投资基金、永赢优选增强债券型证券投资基金、永赢中证科创创业人工智能交易型开放式指数证券投资基金、永赢启航慧选混合型证券投资基金、永赢国证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金联接基金、永赢汇欣混合型证券投资基金、永赢价值核心混合型证券投资基金、永赢国证工业软件主题指数型证券投资基金、

永赢中证工程机械主题指数型证券投资基金、永赢产业机遇智选混合型发起式证券投资基金、永赢上证科创板 200 指数型证券投资基金、永赢中证畜牧养殖产业交易型开放式指数证券投资基金、永赢丰享 90 天持有期债券型证券投资基金、永赢锐见成长混合型证券投资基金、永赢国证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金、永赢现金惠货币市场基金、永赢元鑫稳健多资产六个月持有期混合型基金中基金（FOF）、永赢元嘉平衡多资产 90 天持有期混合型基金中基金（FOF）、永赢致远成长混合型证券投资基金、永赢润泽增强债券型证券投资基金、永赢裕鑫稳健多资产六个月持有期混合型基金中基金（FOF）。

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		
刘庭宇	基金经理	2025 年 01 月 24 日	2026 年 05 月 29 日	8 年	刘庭宇先生，上海财经大学金融硕士，8 年证券相关从业经验。曾任鹏扬基金管理有限公司量化分析师，永赢基金管理有限公司指数与量化投资部基金经理助理。现任永赢基金管理有限公司指数与量化投资部基金经理。
蔡路平	指数与量化投资部总经理兼基金经理	2025 年 05 月 28 日	—	9 年	蔡路平先生，硕士，9 年证券相关从业经验，曾任 DIA Associates 数据分析师；南华基金管理有限公司量化投资部 ETF 基金经理助理；西部利得基金管理有限公司 ETF 投资部副总经理（主持工作），现任永赢基金管理有限公司指数与量化投资部总经理兼基金经理。
孙铭婉	基金经理	2026 年 05 月 29 日	—	4 年	孙铭婉女士，帝国理工学院金融工程硕士，4 年证券相关从业经验。毕业后加入永赢基金管理有限公司。

注：1、任职日期和离任日期一般情况下指公司做出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从《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》及行业协会关于从业人员的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《永赢中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无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 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资授权管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先、比例分配”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。

本基金管理人交易部和风险管理部进行日常投资交易行为监控，风险管理部负责对各账户公平交易进行事后分析，分别于每季度和每年度对所管理的不同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分析，每季度对连续四个季度期间内、不同时间窗下不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，通过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。

报告期内本基金管理人严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，未发现显著违反公平交易的行为。本报告期内，公平交易制度执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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。

本报告期内，本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 8 次，原因是指数投资组合投资策略需要，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，本基金坚持既定的指数化投资策略，主要采取完全复制法进行投资，并根据法律法规和基金合同中的投资比例限制、申购赎回变动情况、股票发生增发或配股、成份股停牌或因法律法规原因被限制投资、市场流动性不足等情况，对股票投资组合进行调整，力争基金净值增长率与标的指数收益率之间的高度正相关和跟踪误差最小化。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末 A500ETF 永赢基金份额净值为 1.4172 元，本报告期内，基金份额净值增长率为 12.41%，同期业绩比较基准收益率为 11.91%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026 年上半年 A 股整体震荡抬升，呈现极致结构性分化的特征，行情节奏先扬后抑、整体修复，其中 A500 上涨 11.9%，沪深 300 上涨 7.6%，中证 1000 上涨 16.0%。1-2 月市场依托宽松流动性走出强势春季行情；3-4 月海外地缘风险扰动市场情绪，指数阶段性震荡回撤；4 月中旬以后，伴随政策持续托底与产业盈利边际改善，市场重回企稳回升通道。从核心驱动来看，宏观层面国内经济弱复苏、内需修复节奏偏弱，对大盘整体上行空间形成明显压制，传统板块盈利缺乏弹性。产业层面成为行情核心主线，AI 算力持续迭代、全球算力供需维持紧平衡，叠加半导体国产替代进程全面提速，硬科技板块订单稳步扩张、产能持续释放。资金层面避险与抱团特征并存，市场持续规避低景气传统板块，增量、存量资金集中涌入高成长科技板块，最终形成“指数走强、多数个股走弱”的典型结构性行情。六月中下旬，高位科技板块估值快速透支、交易拥挤度持续走高，市场定价逻辑逐步从政策与情绪驱动，转向中报业绩兑现为主，市场风格开启初步再平衡。

展望 2026 年下半年，A 股有望延续震荡上行的慢牛格局，市场核心逻辑由上半年的估值扩张，全面切换为盈利兑现与景气验证。受海外流动性波动冲击，A 股在 7 月出现年内幅度最大的结构性调整，市场极致分化、风格快速切换。随着美联储 9 月加息预期逐步降温，北向资金扰动边际收敛，但市场整体风险偏好仍偏审慎。资金面呈现“总量边际收敛、杠杆增量收缩”的特征，估值扩张空间受限，市场正式进入盈利接棒的新阶段，指数持续上行仍需企业业绩改善与产业资本开支落地验证。投资配置将从上半年单一科技抱团转向均衡布局：科技板块坚持去伪存真，重点聚焦算力、半导体设备材料、存储等业绩确定性强的细分领域，算力出海成为重要新增成长逻辑，国内算力基础设施、硬件设备及云服务持续落地东南亚等海外市场，依托绿色低碳、低成本算力优势，持续承接全球 AI 算力外溢需求。同时可采取“科技+高股息”哑铃式配置，把握资源品涨价机会，阶段性布局消费、医药的底部修复行情。整体来看，市场仍存在美联储政策超预期波动、地缘冲突反复、AI

产业资本开支落地不及预期等潜在风险，下半年投资需以业绩与现金流为核心定价锚，在市场震荡中把握高确定性的结构性机会。

中证 A500 指数作为新一代均衡型宽基标杆，以全细分行业均衡选股为核心编制逻辑，全面覆盖 A 股 91 个三级细分板块，均衡布局信息技术、高端制造、新能源、医药、消费与金融板块，有效规避传统宽基行业集中、板块押注的波动风险，适配当前市场轮动加快、主线切换频繁的市场环境。指数精选各细分领域具备核心竞争力的行业龙头与隐形冠军，新质生产力相关产业权重占比突出，深度受益 AI 技术迭代、国产替代、高端制造升级等长期产业趋势，成分企业盈利增速、ROE 水平持续优于市场均值，基本面扎实且成长弹性充足。同时覆盖大量沪深 300 未纳入的中盘优质成长标的，是大盘价值与中小成长之间的均衡配置补充，适合希望一键布局全市场优质资产、不愿频繁切换板块、追求长期稳健复合收益的投资者，可作为底仓工具长期分享国内产业转型与新经济发展红利。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管人进行复核。本基金管理人估值委员会成员包括公司总经理、督察长、投资和研究部门的分管领导、基金运营的分管领导、基金运营部负责人、合规部负责人和风险管理部负责人。以上成员均具有丰富的行业分析、会计核算等证券投资基金行业从业经验及专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议，但不参与最终估值决策。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合基金合同的约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金管理人无应说明的预警信息。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

本报告期内，中信证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在对永赢中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，由永赢基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关永赢中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金的中期报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：永赢中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	1,016,284.93	3,631,065.47
结算备付金		—	—
存出保证金		—	—
交易性金融资产	6.4.7.2	81,539,290.30	205,294,755.81
其中：股票投资		81,539,290.30	205,294,755.81
基金投资		—	—
债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
其他投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—

买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	60,492.63	-
资产总计		82,616,067.86	208,925,821.28
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		483,093.26	3,370,895.68
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		9,263.96	27,027.62
应付托管费		3,087.98	9,009.20
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	109,637.07	188,737.42
负债合计		605,082.27	3,595,669.92
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	57,869,559.00	162,869,559.00
未分配利润	6.4.7.8	24,141,426.59	42,460,592.36
净资产合计		82,010,985.59	205,330,151.36
负债和净资产总计		82,616,067.86	208,925,821.28

注：1、报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.4172 元，基金份额总额 57,869,559.00 份。

2、本基金基金合同于 2025 年 01 月 24 日生效，上年度实际报告期间为 2025 年 01 月 24 日至 2025 年 12 月 31 日。

3、货币资金中包含存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.2 利润表

会计主体：永赢中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 01 月 01	上年度可比期间 2025 年 01 月 24 日
-----	-----	----------------------	-----------------------------

		日至 2026 年 06 月 30 日	(基金合同生效 日) 至 2025 年 06 月 30 日
一、营业总收入		16,574,236.35	7,068,633.17
1. 利息收入		1,177.57	102,818.16
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,177.57	74,669.92
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		-	28,148.24
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		24,844,139.63	4,576,306.06
其中：股票投资收益	6.4.7.10	23,960,729.60	2,599,722.93
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	883,410.03	1,976,583.13
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-8,611,020.36	1,660,018.34
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	339,939.51	729,490.61
减：二、营业总支出		295,814.83	350,830.14
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	110,285.51	142,628.21
2. 托管费	6.4.10.2.2	36,761.80	47,542.79
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	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.19	148,767.52	160,659.14
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		16,278,421.52	6,717,803.03
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		16,278,421.52	6,717,803.03
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		16,278,421.52	6,717,803.03

6.3 净资产变动表

会计主体：永赢中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	162,869,559.00	42,460,592.36	205,330,151.36
二、本期期初净资产	162,869,559.00	42,460,592.36	205,330,151.36
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-105,000,000.00	-18,319,165.77	-123,319,165.77
（一）、综合收益总额	-	16,278,421.52	16,278,421.52
（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）	-105,000,000.00	-34,597,587.29	-139,597,587.29
其中：1. 基金申购款	123,000,000.00	40,556,773.24	163,556,773.24
2. 基金赎回款	-228,000,000.00	-75,154,360.53	-303,154,360.53
（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	57,869,559.00	24,141,426.59	82,010,985.59
项目	上年度可比期间 2025 年 01 月 24 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	507,869,559.00	-	507,869,559.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	27,000,000.00	9,340,671.62	36,340,671.62
（一）、综合收益总额	-	6,717,803.03	6,717,803.03
（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）	27,000,000.00	2,622,868.59	29,622,868.59
其中：1. 基金申购款	603,000,000.00	5,510,628.28	608,510,628.28
2. 基金赎回款	-576,000,000.00	-2,887,759.69	-578,887,759.69
（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	534,869,559.00	9,340,671.62	544,210,230.62

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

芦特尔	虞俏依	曹婷
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

永赢中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理

委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2024]1761号《关于准予永赢中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人永赢基金管理有限公司向社会公开募集，基金合同于 2025 年 1 月 24 日生效。首次设立募集规模为 507,869,559.00 份基金份额。本基金为交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为永赢基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中信证券股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，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，本基金还可以投资于国内依法发行上市的非成份股（包括主板、科创板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、企业债、公司债、次级债、地方政府债、金融债、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、衍生品（包括股指期货、国债期货、股票期权）、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金可根据法律法规的规定参与融资业务和转融通证券出借业务。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不得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衍生品投资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；衍生品及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如法律法规或监管机构对该比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，可以对该比例做相应调整。

本基金的业绩比较基准为：中证 A500 指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会发布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号〈会计报表附注的编制及披露〉》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集证券投资

基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2026 年 1 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；根据财政部、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》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

6.4.6.2 增值税

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资

管产品管理人为纳税人；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税，公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入免征增值税；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税；本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为适用简易计税方法，按照 3% 的征收率计算缴纳增值税；

根据财政部、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》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育附加。

6.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，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。

6.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所

得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
活期存款	5,001.40
等于：本金	5,000.00
加：应计利息	1.40
定期存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
其中：存款期限 1 个月以内	—
存款期限 1-3 个月	—
存款期限 3 个月以上	—
其他存款	1,011,283.53
等于：本金	1,011,240.34
加：应计利息	43.19
合计	1,016,284.93

注：其他存款本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票		74,915,757.78	-	81,539,290.30	6,623,532.52
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		74,915,757.78	-	81,539,290.30	6,623,532.52

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	60,492.63
合计	60,492.63

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-

应付利息	-
预提费用	107,013.57
其他	2,623.50
合计	109,637.07

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	162,869,559.00	162,869,559.00
本期申购	123,000,000.00	123,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-228,000,000.00	-228,000,000.00
本期末	57,869,559.00	57,869,559.00

6.4.7.8 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
上年度末	35,528,610.91	6,931,981.45	42,460,592.36
本期期初	35,528,610.91	6,931,981.45	42,460,592.36
本期利润	24,889,441.88	-8,611,020.36	16,278,421.52
本期基金份额交易产生的变动数	-33,733,071.56	-864,515.73	-34,597,587.29
其中：基金申购款	35,408,697.29	5,148,075.95	40,556,773.24
基金赎回款	-69,141,768.85	-6,012,591.68	-75,154,360.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	26,684,981.23	-2,543,554.64	24,141,426.59

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	25.14
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,152.43
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	1,177.57

注：1、其他包含认/申购款利息收入、结算保证金利息收入、风控金利息收入等。

2、其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股票投资收益--买卖股票差价收入	10,243,843.15
股票投资收益--赎回差价收入	13,716,886.45
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	23,960,729.60

6.4.7.10.2 股票投资收益--买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	190,474,870.83
减：卖出股票成本总额	180,056,133.82
减：交易费用	174,893.86
买卖股票差价收入	10,243,843.15

6.4.7.10.3 股票投资收益--赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
赎回基金份额对价总额	303,154,360.53
减：现金支付赎回款总额	161,118,668.53
减：赎回股票成本总额	128,318,805.55
减：交易费用	-
赎回差价收入	13,716,886.45

6.4.7.10.4 股票投资收益--证券出借差价收入

本基金本报告期无股票投资收益--证券出借差价收入。

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	883,410.03
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	883,410.03

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-8,611,020.36
--股票投资	-8,611,020.36
--债券投资	-
--资产支持证券投资	-
--贵金属投资	-
--其他	-
2. 衍生工具	-
--权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-8,611,020.36

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	-
ETF 基金替代损益	339,939.51
合计	339,939.51

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
其他	69,424.36
合计	148,767.52

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期内，本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
永赢基金管理有限公司（“永赢基金”）	基金管理人
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金托管人、基金销售机构
永赢中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（“永赢中证 A500ETF 发起联接”）	本基金的联接基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 24 日（基金 合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	110,285.51	142,628.21
其中：应支付销售机构的客户维护费	7,936.92	23,509.89
应支付基金管理人的净管理费	102,348.59	119,118.32

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金管理费年费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 24 日（基金合 同生效日）至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	36,761.80	47,542.79

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金托管费年费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间均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。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 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
中信证券	423,792.00	0.7323%	811,092.00	0.4980%
永赢中证 A500 交易型 开放式指数 证券投资基金 发起式联 接基金	24,850,200.00	42.9417%	42,715,300.00	26.2267%

注：除基金管理人之外的其他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。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

本基金本报告期末及上年度可比期末均未持有由关联方保管的银行存款余额，当期及上年度可比期间均未产生利息收入。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2025 年 01 月 24 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额
中信证券	603257	中国瑞林	IPO 网下 申购	499	10,239.48
中信证券	301662	宏工科技	IPO 网下 申购	1,039	27,637.40
中信证券	688775	影石创新	IPO 网下 申购	1,365	64,523.55

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

为更紧密地跟踪标的指数，降低跟踪误差，经与基金托管人协商一致，本基金在报告期内根据基金合同约定的投资策略投资于基金托管人中信证券发行的股票中信证券（600030.SH）。于本报告期末，本基金持有的基金托管人中信证券发行的股票中信证券（600030.SH）24,200 股，期末公允价值为人民币 695,266.00 元，占基金净值比例为 0.85%。于上年度末，本基金持有的基金托管人中信证券发行的股票中信证券（600030.SH）69,800 股，期末公允价值为人民币 2,003,958.00 元，占基金净值比例为 0.98%。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单 价	复牌 日期	复牌 开盘单价	数量 （股）	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
688072	拓荆科	2026 年	重大事	832.00	2026	890.99	500	216,965.15	416,000.00	-

	技	06 月 29 日	项停牌		年 07 月 13 日					
--	---	--------------	-----	--	-------------------	--	--	--	--	--

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金无因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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金无因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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金紧密跟踪标的指数。

本基金的基金管理人视风险管理为规范经营的重点，建立以五道防线为框架的风险控制组织体系。五道防线分别为员工自律及业务部门的自控和互控的第一道防线，合规风控部门监督管理的第二道防线，审计部事后检查的第三道防线，公司风险控制委员会监督管理的第四道防线，董事会及其下设的风险管理委员会对公司风险控制监督管理的第五道防线。

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。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出

现违约、拒绝支付到期本息等情况，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，因此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，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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本期末及上年度末，本基金均未持有短期债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年度末，本基金均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本期末及上年度末，本基金均未持有短期同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本期末及上年度末，本基金均未持有长期债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年度末，本基金均未持有长期资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本期末及上年度末，本基金均未持有长期同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动

性风险进行管理。

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持证券部分在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。

本基金本报告期末无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指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。

本基金可以投资于固定收益品种，且持有银行存款等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 06 月 30 日	1 个月内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	1,016,284.93	-	-	-	-	-	1,016,284.93
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-

存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	-	81,539,290.30	81,539,290.30
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	60,492.63	60,492.63
资产总计	1,016,284.93	-	-	-	-	81,599,782.93	82,616,067.86
负债	-	-	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	483,093.26	483,093.26
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	9,263.96	9,263.96
应付托管费	-	-	-	-	-	3,087.98	3,087.98
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	109,637.07	109,637.07
负债总计	-	-	-	-	-	605,082.27	605,082.27
利率敏感度缺口	1,016,284.93	-	-	-	-	80,994,700.66	82,010,985.59
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产	-	-	-	-	-	-	-
货币资金	3,631,065.47	-	-	-	-	-	3,631,065.47
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	-	205,294,755.81	205,294,755.81
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-

递延所得税资产	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	3,631,065.47	-	-	-	-205,294,755.81	208,925,821.28
负债	-	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	3,370,895.68	3,370,895.68
应付赎回款	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	27,027.62	27,027.62
应付托管费	-	-	-	-	9,009.20	9,009.20
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	188,737.42	188,737.42
负债总计	-	-	-	-	3,595,669.92	3,595,669.92
利率敏感度缺口	3,631,065.47	-	-	-	-201,699,085.89	205,330,151.36

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末及上年度末，本基金均未持有债券，无重大利率风险。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净	公允价值	占基金资产净

		值比例 (%)		值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	81,539,290.30	99.42	205,294,755.81	99.98
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	81,539,290.30	99.42	205,294,755.81	99.98

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险 2. 以下分析,除业绩比较基准发生变动,其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末(2026年06月30日)	上年度末(2025年12月31日)
	业绩比较基准增加 1%	816,422.91	2,002,281.98
	业绩比较基准减少 1%	-816,422.91	-2,002,281.98

注:本基金管理人运用资产-资本定价模型(CAPM)对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析,反映了在其他变量不变的假设下,业绩比较基准所对应的市场组合的价格发生合理、可能的变动时,将对基金净值产生的影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值;第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位:人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	81,123,290.30	203,810,502.73
第二层次	416,000.00	1,266,972.59
第三层次	—	217,280.49

合计	81,539,290.30	205,294,755.81
----	---------------	----------------

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 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。

6.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2026 年 08 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	81,539,290.30	98.70
	其中：股票	81,539,290.30	98.70
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	1, 016, 284. 93	1. 23
8	其他各项资产	60, 492. 63	0. 07
9	合计	82, 616, 067. 86	100. 00

注：上述股票投资包括可退替代款估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末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	261, 789. 00	0. 32
B	采矿业	3, 381, 615. 50	4. 12
C	制造业	57, 916, 554. 65	70. 62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1, 790, 477. 00	2. 18
E	建筑业	999, 279. 00	1. 22
F	批发和零售业	686, 800. 00	0. 84
G	交通运输、仓储和邮政业	1, 825, 615. 00	2. 23
H	住宿和餐饮业	41, 951. 00	0. 05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4, 153, 330. 35	5. 06
J	金融业	7, 930, 084. 00	9. 67
K	房地产业	451, 133. 00	0. 55
L	租赁和商务服务业	588, 178. 80	0. 72
M	科学研究和技术服务业	974, 005. 00	1. 19
N	水利、环境和公共设施管理业	142, 449. 00	0. 17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	27, 360. 00	0. 03
Q	卫生和社会工作	154, 049. 00	0. 19
R	文化、体育和娱乐业	63, 692. 00	0. 08
S	综合	150, 008. 00	0. 18
	合计	81, 538, 370. 30	99. 42

注：上述股票投资组合不包括可退替代款估值增值。

7.2.2 报告期末积极投资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境内积极投资股票。

7.2.3 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投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	2,900	3,683,000.00	4.49
2	300750	宁德时代	6,400	2,515,264.00	3.07
3	300502	新易盛	3,532	2,143,924.00	2.61
4	600519	贵州茅台	1,600	1,896,784.00	2.31
5	603986	兆易创新	1,700	1,385,500.00	1.69
6	601318	中国平安	26,400	1,260,336.00	1.54
7	600036	招商银行	30,600	1,086,300.00	1.32
8	002371	北方华创	1,165	1,030,512.40	1.26
9	688256	寒武纪	641	1,022,747.55	1.25
10	601899	紫金矿业	40,600	1,020,684.00	1.24
11	688041	海光信息	2,605	964,631.50	1.18
12	688008	澜起科技	3,057	947,364.30	1.16
13	000333	美的集团	11,900	898,807.00	1.10
14	002475	立讯精密	12,700	894,080.00	1.09
15	002384	东山精密	3,300	865,755.00	1.06
16	600900	长江电力	30,300	802,041.00	0.98
17	000725	京东方 A	89,800	779,464.00	0.95
18	688981	中芯国际	4,897	777,741.54	0.95
19	603259	药明康德	6,100	759,511.00	0.93
20	688012	中微公司	1,503	704,155.50	0.86
21	600030	中信证券	24,200	695,266.00	0.85
22	601166	兴业银行	41,900	693,864.00	0.85
23	300059	东方财富	31,200	635,856.00	0.78
24	600183	生益科技	3,600	624,240.00	0.76
25	600276	恒瑞医药	11,100	577,644.00	0.70
26	300274	阳光电源	3,600	572,472.00	0.70
27	300408	三环集团	3,400	567,460.00	0.69
28	601398	工商银行	80,000	565,600.00	0.69
29	300476	胜宏科技	1,600	554,288.00	0.68
30	600487	亨通光电	5,000	546,700.00	0.67
31	002594	比亚迪	6,600	526,020.00	0.64
32	002463	沪电股份	3,400	519,520.00	0.63
33	300394	天孚通信	1,712	518,188.16	0.63
34	601211	国泰海通	27,900	507,780.00	0.62
35	000988	华工科技	2,400	443,064.00	0.54

36	600176	中国巨石	5,900	429,992.00	0.52
37	601288	农业银行	70,800	429,756.00	0.52
38	601328	交通银行	65,700	422,451.00	0.52
39	600522	中天科技	6,900	418,692.00	0.51
40	000651	格力电器	11,100	416,250.00	0.51
41	688072	拓荆科技	500	416,000.00	0.51
42	300604	长川科技	1,200	409,704.00	0.50
43	688525	佰维存储	800	395,784.00	0.48
44	603019	中科曙光	3,600	386,028.00	0.47
45	600150	中国船舶	11,200	378,448.00	0.46
46	603993	洛阳钼业	21,500	377,325.00	0.46
47	688498	源杰科技	200	377,200.00	0.46
48	600887	伊利股份	15,600	373,776.00	0.46
49	600584	长电科技	3,600	372,780.00	0.45
50	000338	潍柴动力	13,300	362,425.00	0.44
51	301308	江波龙	500	351,900.00	0.43
52	000858	五粮液	4,600	340,400.00	0.42
53	300857	协创数据	1,000	339,900.00	0.41
54	002281	光迅科技	1,300	334,022.00	0.41
55	601816	京沪高铁	72,500	328,425.00	0.40
56	002415	海康威视	9,100	311,220.00	0.38
57	600309	万华化学	4,500	307,845.00	0.38
58	002008	大族激光	2,000	300,220.00	0.37
59	300475	香农芯创	1,000	300,000.00	0.37
60	000100	TCL 科技	51,300	298,566.00	0.36
61	300124	汇川技术	4,500	298,485.00	0.36
62	600111	北方稀土	6,200	297,910.00	0.36
63	688521	芯原股份	795	295,056.30	0.36
64	000063	中兴通讯	7,900	285,901.00	0.35
65	600000	浦发银行	32,800	282,408.00	0.34
66	002916	深南电路	610	279,319.00	0.34
67	601857	中国石油	32,100	278,628.00	0.34
68	002028	思源电气	1,600	276,800.00	0.34
69	600089	特变电工	12,300	276,750.00	0.34
70	300136	信维通信	2,300	274,275.00	0.33
71	300223	君正股份	1,100	273,790.00	0.33
72	300433	蓝思科技	5,100	273,666.00	0.33
73	601088	中国神华	6,900	269,376.00	0.33
74	688347	华虹宏力	800	269,040.00	0.33
75	688120	华海清科	794	255,810.92	0.31
76	600031	三一重工	14,800	255,744.00	0.31

77	300014	亿纬锂能	3,800	247,114.00	0.30
78	600549	厦门钨业	2,900	247,080.00	0.30
79	002050	三花智控	5,600	245,448.00	0.30
80	002353	杰瑞股份	1,600	244,000.00	0.30
81	002714	牧原股份	6,900	241,431.00	0.29
82	000001	平安银行	23,800	239,190.00	0.29
83	601601	中国太保	8,300	236,716.00	0.29
84	000792	盐湖股份	7,800	235,482.00	0.29
85	002156	通富微电	3,100	235,197.00	0.29
86	600406	国电南瑞	9,900	226,215.00	0.28
87	601668	中国建筑	51,200	222,208.00	0.27
88	300760	迈瑞医疗	1,600	217,328.00	0.26
89	000657	中钨高新	2,200	210,584.00	0.26
90	002436	兴森科技	4,100	208,895.00	0.25
91	002602	世纪华通	14,700	207,270.00	0.25
92	601919	中远海控	15,500	205,530.00	0.25
93	601988	中国银行	35,200	201,344.00	0.25
94	300054	鼎龙股份	1,900	201,343.00	0.25
95	603501	豪威集团	2,100	199,185.00	0.24
96	601728	中国电信	38,300	198,777.00	0.24
97	601012	隆基绿能	15,000	196,800.00	0.24
98	600660	福耀玻璃	3,900	196,716.00	0.24
99	601225	陕西煤业	9,600	195,360.00	0.24
100	600690	海尔智家	9,300	189,813.00	0.23
101	002938	鹏鼎控股	1,800	189,684.00	0.23
102	600941	中国移动	2,200	189,486.00	0.23
103	002230	科大讯飞	4,600	187,864.00	0.23
104	002709	天赐材料	3,600	185,148.00	0.23
105	002352	顺丰控股	5,900	184,434.00	0.22
106	601985	中国核电	20,400	184,212.00	0.22
107	002851	麦格米特	1,100	183,898.00	0.22
108	603799	华友钴业	3,800	183,388.00	0.22
109	600160	巨化股份	3,400	180,234.00	0.22
110	002460	赣锋锂业	2,700	176,580.00	0.22
111	300661	圣邦股份	1,180	169,306.40	0.21
112	000977	浪潮信息	2,400	168,000.00	0.20
113	002202	金风科技	7,000	167,300.00	0.20
114	300442	润泽科技	2,000	166,140.00	0.20
115	000425	徐工机械	20,400	165,036.00	0.20
116	000938	紫光股份	5,700	164,502.00	0.20
117	688126	沪硅产业	4,117	164,227.13	0.20

118	300395	菲利华	1,200	160,476.00	0.20
119	688777	中控技术	1,365	160,387.50	0.20
120	601600	中国铝业	19,500	160,290.00	0.20
121	600938	中国海油	5,900	160,185.00	0.20
122	600028	中国石化	35,900	160,114.00	0.20
123	300346	南大光电	1,720	159,358.00	0.19
124	300033	同花顺	660	159,060.00	0.19
125	002600	领益智造	9,100	157,794.00	0.19
126	002049	紫光国微	1,763	156,466.25	0.19
127	601766	中国中车	30,000	156,000.00	0.19
128	600050	中国联通	38,500	154,000.00	0.19
129	002466	天齐锂业	2,500	153,300.00	0.19
130	600460	士兰微	2,800	153,048.00	0.19
131	002080	中材科技	1,700	153,000.00	0.19
132	601100	恒立液压	1,400	150,584.00	0.18
133	605117	德业股份	1,396	148,227.28	0.18
134	002179	中航光电	3,200	147,840.00	0.18
135	002837	英维克	1,850	147,186.00	0.18
136	002138	顺络电子	2,000	146,200.00	0.18
137	002407	多氟多	2,900	145,667.00	0.18
138	601628	中国人寿	4,100	144,935.00	0.18
139	002185	华天科技	6,400	142,784.00	0.17
140	300390	天华新能	1,500	140,265.00	0.17
141	000568	泸州老窖	1,800	139,536.00	0.17
142	601872	招商轮船	7,900	138,803.00	0.17
143	002241	歌尔股份	6,100	137,433.00	0.17
144	600879	航天电子	6,400	136,256.00	0.17
145	603288	海天味业	4,100	135,956.00	0.17
146	601006	大秦铁路	29,100	134,151.00	0.16
147	601658	邮储银行	27,100	133,603.00	0.16
148	000408	藏格矿业	1,900	131,708.00	0.16
149	688469	芯联集成	12,345	130,980.45	0.16
150	600905	三峡能源	35,200	130,592.00	0.16
151	600893	航发动力	3,400	130,356.00	0.16
152	300037	新宙邦	1,400	129,990.00	0.16
153	600489	中金黄金	7,200	129,960.00	0.16
154	002625	光启技术	4,200	127,344.00	0.16
155	300567	精测电子	400	127,040.00	0.15
156	000630	铜陵有色	19,800	125,928.00	0.15
157	688017	绿的谐波	300	125,358.00	0.15
158	600010	宝钢股份	55,900	124,657.00	0.15

159	600673	东阳光	3,700	124,246.00	0.15
160	688002	睿创微纳	803	124,216.07	0.15
161	002273	水晶光电	3,500	124,180.00	0.15
162	300757	罗博特科	200	123,800.00	0.15
163	300058	蓝色光标	8,980	123,564.80	0.15
164	601888	中国中免	2,300	123,533.00	0.15
165	600118	中国卫星	1,500	123,075.00	0.15
166	601127	赛力斯	2,000	122,500.00	0.15
167	600760	中航沈飞	2,957	121,532.70	0.15
168	002027	分众传媒	24,900	120,516.00	0.15
169	000426	兴业银锡	3,600	118,656.00	0.14
170	601689	拓普集团	2,100	118,482.00	0.14
171	600019	宝钢股份	21,500	116,745.00	0.14
172	000807	云铝股份	5,200	115,128.00	0.14
173	600989	宝丰能源	5,500	111,815.00	0.14
174	002422	科伦药业	2,900	111,708.00	0.14
175	601168	西部矿业	4,100	111,274.00	0.14
176	688271	联影医疗	1,095	110,846.85	0.14
177	600885	宏发股份	3,200	110,368.00	0.13
178	600104	上汽集团	11,300	110,288.00	0.13
179	300782	卓胜微	1,000	109,580.00	0.13
180	600875	东方电气	3,800	109,326.00	0.13
181	601727	上海电气	15,500	108,500.00	0.13
182	600362	江西铜业	2,500	108,250.00	0.13
183	605589	圣泉集团	1,700	108,069.00	0.13
184	002001	新和成	3,800	107,996.00	0.13
185	600988	赤峰黄金	4,100	107,912.00	0.13
186	688396	华润微	1,093	106,622.15	0.13
187	301358	湖南裕能	1,400	106,218.00	0.13
188	002738	中矿资源	1,800	106,182.00	0.13
189	300450	先导智能	2,600	105,872.00	0.13
190	601390	中国中铁	25,200	105,084.00	0.13
191	600667	太极实业	3,600	105,048.00	0.13
192	002126	银轮股份	2,100	104,580.00	0.13
193	000538	云南白药	2,200	104,214.00	0.13
194	600392	盛和资源	3,500	104,195.00	0.13
195	600795	国电电力	22,000	102,740.00	0.13
196	300316	晶盛机电	1,700	102,680.00	0.13
197	600547	山东黄金	4,400	101,596.00	0.12
198	300803	指南针	1,100	100,837.00	0.12
199	600418	江淮汽车	3,900	100,737.00	0.12

200	002812	恩捷股份	1,500	100,365.00	0.12
201	600096	云天化	3,300	100,320.00	0.12
202	600585	海螺水泥	5,900	100,005.00	0.12
203	000831	中国稀土	1,800	99,882.00	0.12
204	601669	中国电建	21,200	99,640.00	0.12
205	000960	锡业股份	2,314	98,784.66	0.12
206	600141	兴发集团	2,100	98,637.00	0.12
207	600482	中国动力	3,000	98,400.00	0.12
208	002648	卫星化学	4,100	96,309.00	0.12
209	002129	TCL 中环	8,000	96,160.00	0.12
210	600580	卧龙电驱	2,900	95,990.00	0.12
211	300015	爱尔眼科	11,500	94,990.00	0.12
212	600346	恒力石化	5,300	93,863.00	0.11
213	002558	巨人网络	3,400	93,704.00	0.11
214	601179	中国西电	6,200	92,504.00	0.11
215	601868	中国能建	34,500	92,115.00	0.11
216	600066	宇通客车	3,400	91,154.00	0.11
217	002195	岩山科技	13,900	90,906.00	0.11
218	600497	驰宏锌锗	7,500	90,825.00	0.11
219	300418	昆仑万维	2,200	88,792.00	0.11
220	600426	华鲁恒升	3,700	88,504.00	0.11
221	000066	中国长城	4,600	87,630.00	0.11
222	000625	长安汽车	12,200	87,474.00	0.11
223	688111	金山办公	406	86,498.30	0.11
224	600157	永泰能源	53,700	86,457.00	0.11
225	600221	海航控股	63,200	85,320.00	0.10
226	688099	晶晨股份	829	85,304.10	0.10
227	000157	中联重科	12,200	85,034.00	0.10
228	002532	天山铝业	7,900	84,767.00	0.10
229	300751	迈为股份	300	84,738.00	0.10
230	600143	金发科技	5,400	83,430.00	0.10
231	600711	盛屯矿业	7,600	83,372.00	0.10
232	002340	格林美	12,600	83,286.00	0.10
233	300438	鹏辉能源	1,000	82,850.00	0.10
234	600011	华能国际	10,900	82,731.00	0.10
235	000933	神火股份	3,900	82,680.00	0.10
236	600048	保利发展	17,700	81,951.00	0.10
237	600895	张江高科	2,200	81,950.00	0.10
238	002493	荣盛石化	7,500	80,625.00	0.10
239	600570	恒生电子	3,800	80,522.00	0.10
240	600115	中国东航	21,000	80,010.00	0.10

241	600438	通威股份	6,600	79,926.00	0.10
242	300017	网宿科技	6,100	79,361.00	0.10
243	002131	利欧股份	16,700	79,325.00	0.10
244	600886	国投电力	5,900	78,529.00	0.10
245	601233	桐昆股份	3,600	77,940.00	0.10
246	002456	欧菲光	8,200	77,572.00	0.09
247	002236	大华股份	4,700	77,503.00	0.09
248	300339	润和软件	2,000	77,020.00	0.09
249	688235	百济神州	300	76,383.00	0.09
250	600352	浙江龙盛	6,300	76,293.00	0.09
251	003816	中国广核	19,300	75,463.00	0.09
252	600196	复星医药	3,300	74,151.00	0.09
253	600009	上海机场	3,200	73,920.00	0.09
254	601058	赛轮轮胎	6,400	73,792.00	0.09
255	600026	中远海能	4,100	73,554.00	0.09
256	000301	东方盛虹	6,400	73,280.00	0.09
257	601360	三六零	8,400	72,996.00	0.09
258	603659	璞泰来	2,500	72,325.00	0.09
259	002555	三七互娱	3,800	71,706.00	0.09
260	000768	中航西飞	3,500	71,680.00	0.09
261	002128	电投能源	3,100	71,672.00	0.09
262	300458	全志科技	1,800	71,028.00	0.09
263	002595	豪迈科技	1,520	70,832.00	0.09
264	002472	双环传动	1,700	70,567.00	0.09
265	605499	东鹏饮料	570	70,355.10	0.09
266	300207	欣旺达	3,700	70,263.00	0.09
267	600415	小商品城	6,900	70,104.00	0.09
268	000975	山金国际	4,100	69,700.00	0.08
269	601111	中国国航	11,500	69,575.00	0.08
270	300759	康龙化成	2,400	69,432.00	0.08
271	600029	南方航空	13,300	68,894.00	0.08
272	002074	国轩高科	2,500	68,775.00	0.08
273	002517	恺英网络	4,200	68,250.00	0.08
274	300001	特锐德	1,800	68,094.00	0.08
275	600674	川投能源	4,800	68,016.00	0.08
276	300496	中科创达	1,100	67,969.00	0.08
277	301236	软通动力	1,600	67,920.00	0.08
278	688036	传音控股	1,152	67,910.40	0.08
279	600219	南山铝业	17,000	67,830.00	0.08
280	002601	龙佰集团	4,100	67,568.00	0.08
281	601186	中国铁建	11,300	67,235.00	0.08

282	300347	泰格医药	1,400	67,200.00	0.08
283	601117	中国化学	9,100	66,885.00	0.08
284	300474	景嘉微	1,100	66,528.00	0.08
285	600233	圆通速递	4,200	66,150.00	0.08
286	600436	片仔癀	600	65,568.00	0.08
287	601877	正泰电器	2,600	65,182.00	0.08
288	002465	海格通信	5,100	65,127.00	0.08
289	603979	金诚信	1,100	64,933.00	0.08
290	002821	凯莱英	400	64,800.00	0.08
291	300115	长盈精密	2,300	64,262.00	0.08
292	600839	四川长虹	9,200	64,216.00	0.08
293	600372	中航机载	5,900	64,015.00	0.08
294	300568	星源材质	3,400	63,648.00	0.08
295	000547	航天发展	3,300	63,195.00	0.08
296	000733	振华科技	1,100	62,304.00	0.08
296	002756	永兴材料	1,100	62,304.00	0.08
298	688047	龙芯中科	400	61,868.00	0.08
299	300024	机器人	3,200	61,856.00	0.08
300	002497	雅化集团	3,000	61,110.00	0.07
301	002155	湖南黄金	2,550	60,868.50	0.07
302	002130	沃尔核材	3,200	60,672.00	0.07
303	600741	华域汽车	3,900	60,528.00	0.07
304	601021	春秋航空	1,300	59,254.00	0.07
305	000963	华东医药	2,100	59,052.00	0.07
306	688506	百利天恒	200	58,806.00	0.07
307	000878	云南铜业	3,700	58,756.00	0.07
308	001979	招商蛇口	9,100	58,513.00	0.07
309	300073	当升科技	1,200	57,648.00	0.07
310	300919	中伟新材	1,300	56,875.00	0.07
311	688608	恒玄科技	340	56,844.60	0.07
312	300012	华测检测	4,100	56,826.00	0.07
313	002444	巨星科技	1,800	55,980.00	0.07
314	300083	创世纪	4,100	55,842.00	0.07
315	603606	东方电缆	1,340	55,623.40	0.07
316	000034	神州数码	1,980	54,945.00	0.07
317	002271	东方雨虹	4,600	54,602.00	0.07
318	688578	艾力斯	500	54,600.00	0.07
319	000423	东阿阿胶	1,200	54,432.00	0.07
320	002414	高德红外	4,100	54,366.00	0.07
321	688213	思特威	500	53,535.00	0.07
322	688122	西部超导	852	53,514.12	0.07

323	601319	中国人保	7,900	53,404.00	0.07
324	601677	明泰铝业	3,200	53,120.00	0.06
325	300748	金力永磁	1,700	52,445.00	0.06
326	688331	荣昌生物	400	52,104.00	0.06
327	002078	太阳纸业	4,100	51,209.00	0.06
328	603129	春风动力	200	51,160.00	0.06
329	300677	英科医疗	1,300	50,921.00	0.06
330	601615	明阳智能	4,400	50,908.00	0.06
331	300142	沃森生物	3,900	50,661.00	0.06
332	601800	中国交建	8,800	50,248.00	0.06
333	600039	四川路桥	6,400	50,048.00	0.06
334	600226	亨通股份	5,200	49,868.00	0.06
335	002831	裕同科技	1,400	49,784.00	0.06
336	600699	均胜电子	2,300	49,703.00	0.06
337	002432	九安医疗	700	49,476.00	0.06
338	002252	上海莱士	11,300	49,042.00	0.06
339	688617	惠泰医疗	270	49,021.20	0.06
340	603650	彤程新材	500	48,990.00	0.06
341	002920	德赛西威	600	48,900.00	0.06
342	688599	天合光能	3,434	48,488.08	0.06
343	002064	华峰化学	5,100	48,399.00	0.06
344	601633	长城汽车	3,200	48,288.00	0.06
345	300432	富临精工	2,400	48,216.00	0.06
346	300454	深信服	500	48,100.00	0.06
347	002294	信立泰	1,500	47,835.00	0.06
348	688223	晶科能源	10,007	47,533.25	0.06
349	300342	天银机电	1,000	47,000.00	0.06
350	600588	用友网络	5,100	46,818.00	0.06
351	001965	招商公路	5,100	46,716.00	0.06
352	688266	泽璟制药	400	46,664.00	0.06
353	000661	长春高新	700	46,620.00	0.06
354	300832	新产业	1,100	46,200.00	0.06
355	002025	航天电器	600	45,732.00	0.06
356	688169	石头科技	480	45,585.60	0.06
357	300763	锦浪科技	500	45,175.00	0.06
358	601607	上海医药	2,900	44,660.00	0.05
359	605090	九丰能源	1,200	44,604.00	0.05
360	000002	万科 A	15,000	44,400.00	0.05
361	000786	北新建材	2,400	43,416.00	0.05
362	600516	方大炭素	7,000	43,190.00	0.05
363	601618	中国中冶	17,700	43,188.00	0.05

364	300699	光威复材	1,500	42,975.00	0.05
365	600177	雅戈尔	5,700	42,921.00	0.05
366	300724	捷佳伟创	600	42,360.00	0.05
367	688676	金盘科技	500	42,320.00	0.05
368	000519	中兵红箭	2,000	42,140.00	0.05
369	002176	江特电机	4,200	42,042.00	0.05
370	603806	福斯特	2,500	41,975.00	0.05
371	300866	安克创新	400	41,800.00	0.05
372	600499	科达制造	3,000	41,400.00	0.05
373	002085	万丰奥威	3,700	41,033.00	0.05
373	300251	光线传媒	3,700	41,033.00	0.05
375	000617	中油资本	6,200	40,858.00	0.05
376	688180	君实生物	1,207	40,820.74	0.05
377	000623	吉林敖东	2,300	40,779.00	0.05
378	002318	久立特材	1,700	40,630.00	0.05
379	002459	晶澳科技	5,000	40,500.00	0.05
380	000032	深桑达 A	1,600	39,920.00	0.05
381	603087	甘李药业	700	39,732.00	0.05
382	600085	同仁堂	1,700	39,287.00	0.05
383	002065	东华软件	5,500	39,270.00	0.05
384	300003	乐普医疗	3,300	39,105.00	0.05
385	000400	许继电气	1,800	39,060.00	0.05
386	002266	浙富控股	7,700	38,962.00	0.05
387	688472	阿特斯	3,600	38,952.00	0.05
388	603596	伯特利	1,564	38,849.76	0.05
389	002044	美年健康	7,700	38,731.00	0.05
390	002223	鱼跃医疗	1,500	38,490.00	0.05
391	600515	海南机场	14,000	38,360.00	0.05
392	300409	道氏技术	1,900	37,867.00	0.05
393	002405	四维图新	5,800	37,526.00	0.05
394	000999	华润三九	1,660	37,333.40	0.05
395	000415	渤海租赁	9,100	37,037.00	0.05
396	601216	君正集团	8,300	37,018.00	0.05
397	603766	隆鑫通用	3,100	36,983.00	0.05
398	000683	博源化工	6,400	36,864.00	0.04
399	000039	中集集团	4,500	36,495.00	0.04
400	600704	物产中大	7,700	36,344.00	0.04
401	300122	智飞生物	3,100	36,239.00	0.04
402	600332	白云山	1,800	36,072.00	0.04
403	600862	中航高科	2,000	36,060.00	0.04
404	600521	华海药业	2,500	36,000.00	0.04

405	000967	盈峰环境	3,400	35,802.00	0.04
406	600323	瀚蓝环境	1,300	35,698.00	0.04
407	600018	上港集团	7,500	35,400.00	0.04
408	600312	平高电气	2,000	35,320.00	0.04
409	302132	中航成飞	600	34,992.00	0.04
410	600803	新奥股份	2,200	34,760.00	0.04
411	300972	万辰集团	200	34,682.00	0.04
412	600166	福田汽车	11,800	34,338.00	0.04
413	600153	建发股份	4,300	34,099.00	0.04
414	000887	中鼎股份	1,900	33,991.00	0.04
415	603260	合盛硅业	700	33,782.00	0.04
416	600765	中航重机	2,600	33,592.00	0.04
417	600316	洪都航空	1,200	33,528.00	0.04
418	688065	凯赛生物	700	33,495.00	0.04
419	688188	柏楚电子	308	32,863.60	0.04
420	002410	广联达	4,000	32,640.00	0.04
421	688390	固德威	300	32,553.00	0.04
422	300558	贝达药业	500	32,535.00	0.04
423	000830	鲁西化工	2,700	32,400.00	0.04
424	002007	华兰生物	2,600	31,694.00	0.04
425	600529	山东药玻	1,700	31,365.00	0.04
426	000738	航发控制	1,700	31,093.00	0.04
427	600398	海澜之家	5,900	30,857.00	0.04
428	603568	伟明环保	2,000	30,760.00	0.04
429	601018	宁波港	9,700	30,555.00	0.04
430	688114	华大智造	598	30,545.84	0.04
431	600038	中直股份	1,200	30,348.00	0.04
432	601000	唐山港	7,300	30,295.00	0.04
433	600208	衢州发展	10,700	30,281.00	0.04
434	002389	航天彩虹	1,700	30,209.00	0.04
435	002603	以岭药业	2,000	30,000.00	0.04
436	688009	中国通号	6,300	29,988.00	0.04
437	603605	珀莱雅	500	29,960.00	0.04
438	688005	容百科技	978	29,926.80	0.04
439	600008	首创环保	11,000	29,920.00	0.04
440	603392	万泰生物	1,100	29,667.00	0.04
441	600170	上海建工	13,300	29,526.00	0.04
442	000932	华菱钢铁	8,500	29,495.00	0.04
443	600998	九州通	6,200	29,078.00	0.04
444	603816	顾家家居	1,300	29,068.00	0.04
445	603939	益丰药房	1,600	28,768.00	0.04

446	600511	国药股份	1,100	28,644.00	0.03
447	600820	隧道股份	5,400	28,134.00	0.03
448	601238	广汽集团	5,500	27,940.00	0.03
449	600161	天坛生物	2,400	27,792.00	0.03
450	301550	斯菱智驱	300	27,429.00	0.03
451	300118	东方日升	2,200	27,390.00	0.03
452	002607	中公教育	15,200	27,360.00	0.03
453	601799	星宇股份	300	27,186.00	0.03
454	601567	三星电气	1,800	26,892.00	0.03
455	603885	吉祥航空	2,600	26,754.00	0.03
456	688116	天奈科技	700	26,740.00	0.03
457	300896	爱美客	300	26,160.00	0.03
458	000833	粤桂股份	1,100	25,762.00	0.03
459	601880	辽港股份	18,400	25,392.00	0.03
460	603486	科沃斯	500	25,375.00	0.03
461	600486	扬农化工	500	25,350.00	0.03
462	600535	天士力	1,900	25,137.00	0.03
463	688166	博瑞医药	700	24,507.00	0.03
464	600816	建元信托	9,800	23,912.00	0.03
465	002544	普天科技	1,300	23,686.00	0.03
466	002244	滨江集团	3,100	23,560.00	0.03
467	600754	锦江酒店	1,300	23,387.00	0.03
468	688303	大全能源	1,314	22,903.02	0.03
469	002120	韵达股份	3,600	22,896.00	0.03
470	600064	南京高科	3,200	22,816.00	0.03
471	603899	晨光股份	1,100	22,693.00	0.03
472	300144	宋城演艺	3,900	22,659.00	0.03
473	601155	新城控股	2,200	22,572.00	0.03
474	601866	中远海发	9,700	21,437.00	0.03
475	300457	赢合科技	1,000	21,080.00	0.03
476	300676	华大基因	600	21,036.00	0.03
477	600655	豫园股份	5,100	20,961.00	0.03
478	600635	大众公用	4,800	20,544.00	0.03
479	000998	隆平高科	2,700	20,358.00	0.02
480	600763	通策医疗	600	20,328.00	0.02
481	000035	中国天楹	4,100	19,803.00	0.02
482	300573	兴齐眼药	483	19,687.08	0.02
483	300100	双林股份	700	19,446.00	0.02
484	300049	福瑞医科	500	19,440.00	0.02
485	300601	康泰生物	1,700	19,278.00	0.02
486	600663	陆家嘴	3,000	18,840.00	0.02

487	600258	首旅酒店	1,700	18,564.00	0.02
488	600004	白云机场	2,500	18,150.00	0.02
489	600859	王府井	1,900	17,442.00	0.02
490	002091	江苏国泰	2,400	17,352.00	0.02
491	300070	碧水源	5,400	17,226.00	0.02
492	600864	哈投股份	3,200	16,608.00	0.02
493	688063	派能科技	300	15,981.00	0.02
494	000069	华侨城 A	9,400	15,416.00	0.02
495	301078	孩子王	2,200	14,872.00	0.02
496	002292	奥飞娱乐	2,200	14,432.00	0.02
497	600325	华发股份	5,400	12,474.00	0.02
498	603833	欧派家居	400	12,044.00	0.01
499	002572	索菲亚	1,500	10,950.00	0.01
500	002891	中宠股份	400	10,688.00	0.01

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	6,894,990.63	3.36
2	601318	中国平安	3,700,580.00	1.80
3	601899	紫金矿业	3,383,091.00	1.65
4	688041	海光信息	3,358,556.11	1.64
5	600036	招商银行	2,617,688.00	1.27
6	688008	澜起科技	1,903,792.05	0.93
7	600900	长江电力	1,815,524.00	0.88
8	601166	兴业银行	1,799,134.00	0.88
9	688981	中芯国际	1,691,070.44	0.82
10	603986	兆易创新	1,565,432.00	0.76
11	600030	中信证券	1,533,727.00	0.75
12	600276	恒瑞医药	1,505,880.00	0.73
13	601398	工商银行	1,416,914.00	0.69
14	603259	药明康德	1,288,858.00	0.63
15	601211	国泰海通	1,196,019.00	0.58
16	002371	北方华创	1,165,778.00	0.57
17	601288	农业银行	1,165,232.00	0.57
18	603993	洛阳钼业	1,103,108.00	0.54

19	601328	交通银行	1,044,364.00	0.51
20	600436	片仔癀	1,042,055.00	0.51

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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	10,830,943.50	5.27
2	601318	中国平安	6,691,564.00	3.26
3	601899	紫金矿业	6,121,313.00	2.98
4	600036	招商银行	4,850,253.00	2.36
5	688041	海光信息	4,367,958.90	2.13
6	600900	长江电力	3,351,087.00	1.63
7	601166	兴业银行	3,224,495.00	1.57
8	688008	澜起科技	2,875,298.38	1.40
9	688981	中芯国际	2,756,534.50	1.34
10	600030	中信证券	2,717,261.00	1.32
11	600276	恒瑞医药	2,606,316.00	1.27
12	603986	兆易创新	2,525,479.00	1.23
13	601398	工商银行	2,489,940.00	1.21
14	603259	药明康德	2,425,193.00	1.18
15	601211	国泰海通	2,095,095.00	1.02
16	601288	农业银行	2,036,189.00	0.99
17	603993	洛阳钼业	1,958,761.00	0.95
18	601328	交通银行	1,879,042.00	0.92
19	300308	中际旭创	1,849,767.00	0.90
20	688256	寒武纪	1,841,999.00	0.90

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。

7.4.3 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	117,060,788.22
卖出股票收入（成交）总额	190,474,870.83

注：买入股票成本总额、卖出股票收入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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资前十名证券的发行主体本期被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚说明

本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同约定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-

2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	60,492.63
8	其他	—
9	合计	60,492.63

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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		永赢中证 A500 交易型 开放式指数证券投资 基金发起式联接基金	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
333	173,782.46	54,009,661.00	93.3300%	3,859,898.00	6.6700%	24,850,200.00	42.9417%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“永赢中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2025 年 01 月 24 日）基金份额总 额	507,869,559.00
本报告期期初基金份额总额	162,869,559.00
本报告期基金总申购份额	123,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	228,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	57,869,559.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金管理人的基金投资策略严格遵循本基金《基金合同》及《招募说明书》中披露的基本投资策略，未发生显著的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自合同生效日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 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	永赢基金管理有限公司
受到调查或处罚等措施的时间	2026 年 02 月 09 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	责令改正
受到调查或处罚等措施的原因	其他问题（销售管理）
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司高度重视，已通过完善制度建设、加强培训宣导等措施完成整改，整改结果已经监管部门验收通过。
其他	无

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

管理人相关从业人员受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	高级管理人员 1
受到调查或处罚等措施的时间	2026 年 02 月 09 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局
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	其他问题（销售管理）
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司高度重视，已通过完善制度建设、加强培训宣导等措施完成整改，整改结果已经监管部门验收通过。
其他	无
受到调查或处罚等措施的主体	高级管理人员 2
受到调查或处罚等措施的时间	2026 年 02 月 09 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局
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	其他问题（销售管理）

受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司高度重视，已通过完善制度建设、加强培训宣导等措施完成整改，整改结果已经监管部门验收通过。
其他	无

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期，基金托管人未受到调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期，基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
金融街证券	4	307,535,659.05	100.00%	59,930.66	100.00%	-

注：1、根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上，选择基金专用交易席位。

2、基金交易单元的选择程序如下：(1) 本基金管理人根据证券公司选择标准进行评估并确定选用的证券公司。(2) 本基金管理人与被选择的证券公司签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
金融街证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 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	永赢基金管理有限公司关于旗下部分基金增加申购赎回代理券商的公告	中国证监会规定媒介	2026年01月12日
2	永赢基金管理有限公司关于上海分公司负责人变更的公告	中国证监会规定媒介	2026年01月12日
3	永赢中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2026年01月21日
4	永赢基金管理有限公司关于旗下部分公募基金产品风险等级变动的公告	中国证监会规定媒介	2026年01月31日
5	永赢基金管理有限公司关于旗下部分基金增加申购赎回代理券商的公告	中国证监会规定媒介	2026年02月12日
6	永赢基金管理有限公司关于董事变更情况的公告	中国证监会规定媒介	2026年03月11日
7	永赢基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况(2025 年度)	中国证监会规定媒介	2026年03月31日
8	永赢中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会规定媒介	2026年03月31日
9	永赢中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2026年04月22日
10	永赢基金管理有限公司关于旗下部分基金增加山西证券股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	中国证监会规定媒介	2026年04月30日
11	永赢基金对外行使投票表决权（2025 年度）情况信息披露	中国证监会规定媒介	2026年04月30日
12	永赢基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中国国际金融股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	中国证监会规定媒介	2026年05月13日
13	永赢基金管理有限公司深圳分公司成立公告	中国证监会规定媒介	2026年05月22日
14	永赢中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书(2026 年第 1 号)	中国证监会规定媒介	2026年05月30日
15	永赢中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理变更公告	中国证监会规定媒介	2026年05月30日
16	永赢中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新(2026 年第 1 号)	中国证监会规定媒介	2026年05月30日
17	永赢基金管理有限公司关于调整证券投资基金主流流动性服务商的公告	中国证监会规定媒介	2026年06月24日
18	永赢中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书(2026 年第 2 号)	中国证监会规定媒介	2026年06月30日
19	永赢中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新(2026 年第 2 号)	中国证监会规定媒介	2026年06月30日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20260101-20260514, 20260522-20260527	61,413,800.00	3,030,300.00	64,444,100.00	0.00	0.00%
	2	20260624-20260624	14,945,812.00	193,756,322.00	199,724,699.00	8,977,435.00	15.51%
永赢中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1	20260101-20260302, 20260305-20260630	42,715,300.00	14,379,100.00	32,244,200.00	24,850,200.00	42.94%
产品特有风险							
本基金在本报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20%的情况,存在可能因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、巨额赎回风险、净值波动风险以及因巨额赎回造成基金规模持续低于正常水平而面临转换运作方式、与其他基金合并或终止基金合同等特有风险。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予永赢中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金注册的文件;
2. 《永赢中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;

3. 《永赢中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;
4. 《永赢中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及其更新 (如有);
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照;
6. 基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

地点为管理人地址: 上海市浦东新区世纪大道 210 号二十一世纪大厦 21、22、23、27 层

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间亲临上述存放地点免费查阅, 也可在本基金管理人的网站进行查阅, 查询网址: www.maxwealthfund.com

如有疑问, 可以向本基金管理人永赢基金管理有限公司咨询。

客户服务电话: 400-805-8888

永赢基金管理有限公司

2026 年 08 月 31 日