

中银证券中证 500 交易型开放式指数证券  
投资基金  
2024 年中期报告

2024 年 6 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

送出日期：2024 年 8 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责任。本中期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 2024 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
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	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>7</b>
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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况	38
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
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	54
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	54
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12	投资组合报告附注	54
<b>§ 8</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>55</b>
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2	期末上市基金前十名持有人	55
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
8.4	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	56
<b>§ 9</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>56</b>
<b>§ 10</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>56</b>
10.1	基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4	基金投资策略的改变	57
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	57
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	57
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
10.8	其他重大事件	59
<b>§ 11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>59</b>
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	60
<b>§ 12</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>60</b>
12.1	备查文件目录	60
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	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	59,466,080.00 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	亓磊
	联系电话	021-20328000
	电子邮箱	gmkf@bocichina.com
客户服务电话	021-61195566, 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	宁敏	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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.bocifunds.com
基金中期报告备置地点	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
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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市浦东新区东育路 588 号 前滩中心 42 楼

## § 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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-2,913,460.75
本期利润	-4,637,586.89
加权平均基金份额本期利润	-0.0785
本期加权平均净值利润率	-7.35%
本期基金份额净值增长率	-7.96%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	940,351.33
期末可供分配基金份额利润	0.0158
期末基金资产净值	60,406,431.33
期末基金份额净值	1.0158
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	1.58%

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

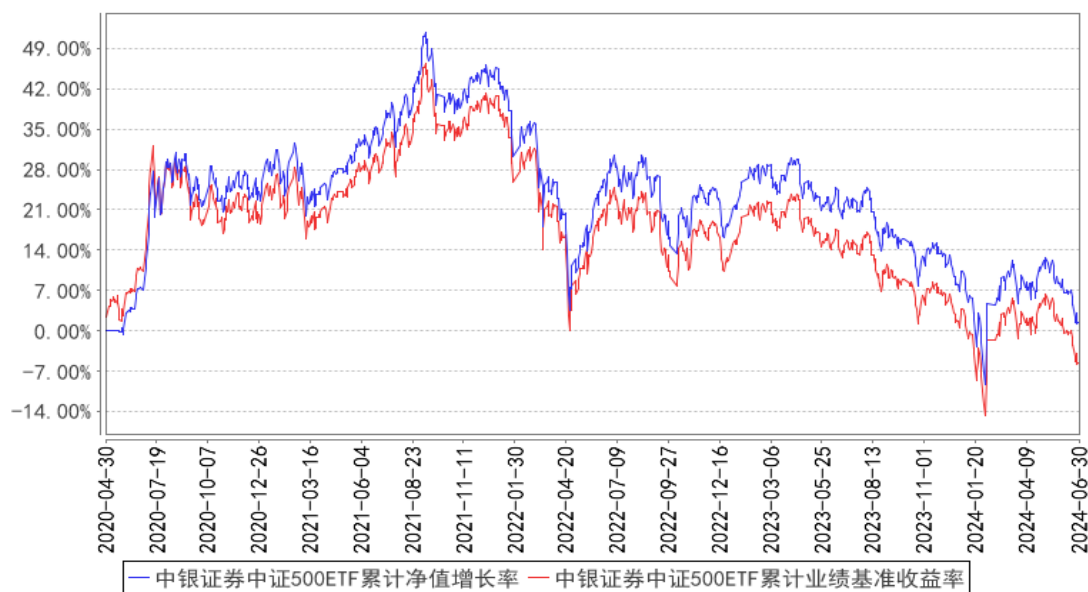
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	-6.17%	0.95%	-6.89%	0.96%	0.72%	-0.01%
过去三个月	-5.34%	1.13%	-6.50%	1.14%	1.16%	-0.01%
过去六个月	-7.96%	1.59%	-8.96%	1.61%	1.00%	-0.02%
过去一年	-16.71%	1.26%	-17.60%	1.27%	0.89%	-0.01%
过去三年	-24.78%	1.18%	-27.40%	1.20%	2.62%	-0.02%
自基金合同生效起至今	1.58%	1.17%	-5.43%	1.20%	7.01%	-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：本基金合同生效日为 2020 年 4 月 30 日。

## 3.3 其他指标

注：无。

## § 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 2024 年 3 月 31 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、中国通用技术（集团）控股有限责任公司、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、井冈山郝乾企业管理中心（有限合伙）、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。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 2024 年 6 月 30 日，本管理人共管理 45 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、中银证券安泰债券型证券投资基金、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、中银证券均衡成长混合型证券投资基金、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）、中银证券慧泽进取 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、中银证券优势成长混合型



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。

#### 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	-	6 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基金经理。
计伟	本基金的基金经理	2021 年 6 月 8 日	-	16 年	计伟，硕士研究生，中国国籍，已取得证券、基金从业资格。2012 年 1 月至 2016 年 8 月任职于华安基金管理有限公司，担任基金经理；2016 年 8 月至 2019 年 7 月任职于汇安基金管理有限公司，担任指数与量化投资副总经理、ETF 投资部总经理、基金经理；2019 年 10 月加入中银国际证券股份有限公司，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，现任基金管理部 ETF 投资团队负责人及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

#### 4.2 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 公平交易制度的执行情况

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。公司旗下投资组合严格按照制度的规定，参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，主要包括授权、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环节。研究团队负责提供投资研究支持，投资团队负责投资决策，交易室负责实施交易并实时监控，投资监督团队负责事前监督、事中检查和事后稽核，对交易情况进行合理性分析。通过多部门的协作互控，保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

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，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同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 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

过去半年权益市场整体震荡，期间中证 500 下跌 9.0%，强于创业板指、科创 50，弱于沪深

300、万得全 A。上半年对指数涨幅正贡献最大的三大成分行业为通信、银行、电力及公用事业，负贡献最大的三大成分行业为医药、计算机、非银金融。截至 6 月底，中证 500 指数滚动市盈率 21 倍，处于过去三年 37%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。报告期内标的指数完成一次成分股定期调整，调整后行业结构整体稳定，电子行业占比小幅增加。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 1.0158 元；本报告期基金份额净值增长率为-7.96%，业绩比较基准收益率为-8.96%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年特别是进入二季度后权益市场整体表现较为低迷，市场成交额逐步走低，悲观气氛较浓，风险偏好较低，市场信心较为脆弱。另一方面，上半年经济基本面的复苏仍面临挑战，从消费到工业企业利润等指标上尚未看到显著的恢复迹象，但同时，我们也看到了从设备更新到房地产等支持政策的陆续出台，以及中报预告中部分行业的亮眼表现。展望下半年，经济整体增长的动能修复尚需耐心，权益市场的机会或更多呈现结构性。

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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未实施利润分配。

#### 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。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本年度中期报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 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：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			

货币资金	6.4.7.1	838,160.17	678,817.35
结算备付金		654.52	2,024.20
存出保证金		8,309.89	1,070.23
交易性金融资产	6.4.7.2	59,860,040.57	60,692,263.02
其中：股票投资		59,849,039.75	60,692,263.02
基金投资		-	-
债券投资		11,000.82	-
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	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	110,692.39
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	75,409.12	-
资产总计		60,782,574.27	61,484,867.19
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
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		251,981.15	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		7,495.75	7,556.10
应付托管费		2,498.58	2,518.70
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	6.4.7.9	114,167.46	257,681.67
负债合计		376,142.94	267,756.47
<b>净资产：</b>			

实收基金	6.4.7.10	59,466,080.00	55,466,080.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	940,351.33	5,751,030.72
净资产合计		60,406,431.33	61,217,110.72
负债和净资产总计		60,782,574.27	61,484,867.19

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0158 元，基金份额总额 59,466,080.00 份。

## 6.2 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-4,368,851.49	2,370,494.69
1. 利息收入		1,647.64	1,058.26
其中：存款利息收入	6.4.7.13	1,647.64	1,058.26
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）		-2,737,427.83	-347,303.72
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-3,545,384.96	-1,068,875.24
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	0.82	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	807,956.31	721,571.52
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）	6.4.7.20	-1,724,126.14	2,698,182.28
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”	6.4.7.21	91,054.84	18,557.87

号填列)			
<b>减：二、营业总支出</b>		268,735.40	291,628.22
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	47,262.26	46,704.76
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	15,754.11	15,568.27
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	205,719.03	229,355.19
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-4,637,586.89	2,078,866.47
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-4,637,586.89	2,078,866.47
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-4,637,586.89	2,078,866.47

### 6.3 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 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）	4,000,000.00	-	-4,810,679.39	-810,679.39
（一）、综合收益总额	-	-	-4,637,586.89	-4,637,586.89

(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)	4,000,000.00	-	-173,092.50	3,826,907.50
其中: 1. 基金申购款	22,000,000.00	-	1,357,399.30	23,357,399.30
2. 基金赎回款	-18,000,000.00	-	-1,530,491.80	-19,530,491.80
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	59,466,080.00	-	940,351.33	60,406,431.33
项目	上年度可比期间			
	2023年1月1日至2023年6月30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	51,466,080.00	-	9,362,094.99	60,828,174.99
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	51,466,080.00	-	9,362,094.99	60,828,174.99
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	1,939,465.27	1,939,465.27
(一)、综合收益总额	-	-	2,078,866.47	2,078,866.47
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-	-	-139,401.20	-139,401.20
其中: 1. 基金申购款	2,000,000.00	-	415,640.44	2,415,640.44



2. 基金赎回款	-2,000,000.00	-	-555,041.64	-2,555,041.64
(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	51,466,080.00	-	11,301,560.26	62,767,640.26

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：

<u>周冰</u>	<u>沈锋</u>	<u>戴景义</u>
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

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》核准,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。

本财务报表由本基金的基金管理人中银国际证券股份有限公司于 2024 年 8 月 30 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、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“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《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》和其他在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间的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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 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。

## 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售

股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

#### 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 2024 年 6 月 30 日
活期存款	838,160.17
等于：本金	838,092.04
加：应计利息	68.13
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	838,160.17

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	70,004,857.43	-	59,849,039.75	-10,155,817.68
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券   交易所市场	11,000.00	0.82	11,000.82	0.00

	银行间市场	-	-	-	-
	合计	11,000.00	0.82	11,000.82	0.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
	合计	70,015,857.43	0.82	59,860,040.57	-10,155,817.68

#### 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

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.3.2 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。

##### 6.4.7.3.3 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。

#### 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

注：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

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金本报告期内未计提买入返售金融资产减值准备。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内未计提债权投资减值准备。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

##### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内未计提其他债权投资减值准备。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

##### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

##### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

#### 6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	75,409.12
合计	75,409.12

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6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	11,081.09
其中：交易所市场	11,081.09
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	68,086.37
应付指数使用费	35,000.00
合计	114,167.46

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	55,466,080.00	55,466,080.00
本期申购	22,000,000.00	22,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-18,000,000.00	-18,000,000.00
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	59,466,080.00	59,466,080.00

#### 6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期无其他综合收益。

#### 6.4.7.12 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	30,495,905.57	-24,744,874.85	5,751,030.72
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	30,495,905.57	-24,744,874.85	5,751,030.72
本期利润	-2,913,460.75	-1,724,126.14	-4,637,586.89
本期基金份额交易产生的变动数	2,299,053.92	-2,472,146.42	-173,092.50
其中：基金申购款	11,836,765.03	-10,479,365.73	1,357,399.30
基金赎回款	-9,537,711.11	8,007,219.31	-1,530,491.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	29,881,498.74	-28,941,147.41	940,351.33

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	1,293.42
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	316.63
其他	37.59
合计	1,647.64

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-2,796,486.65
股票投资收益——赎回差价收入	-748,898.31
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	-3,545,384.96

**6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	17,546,776.77
减：卖出股票成本总额	20,303,932.40
减：交易费用	39,331.02
买卖股票差价收入	-2,796,486.65

**6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
赎回基金份额对价总额	19,530,491.80
减：现金支付赎回款总额	10,540,896.80
减：赎回股票成本总额	9,738,493.31
减：交易费用	-
赎回差价收入	-748,898.31

**6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期无股票投资收益-申购差价收入。

**6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入**

注：本基金本报告期内无股票投资收益-证券出借差价收入。

**6.4.7.15 债券投资收益****6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	0.82
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	0.82

**6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

注：本基金本报告期内无股票投资收益-买卖债券差价收入。

**6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内无债券投资收益-赎回差价收入。



**6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内无债券投资收益-申购差价收入。

**6.4.7.16 资产支持证券投资收益****6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入**

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

**6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-赎回差价收入。

**6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-申购差价收入。

**6.4.7.17 贵金属投资收益****6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

**6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-赎回差价收入。

**6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-申购差价收入。

**6.4.7.18 衍生工具收益****6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

**6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本基金本报告期内无衍生工具收益-其他投资收益。

**6.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	807,956.31
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	807,956.31

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-1,724,126.14
股票投资	-1,724,126.14
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	-1,724,126.14

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	91,054.84
合计	91,054.84

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。

#### 6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	2,940.02
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
银行费用	1,020.00
指数使用费	70,000.00

其他费用	91,977.45
合计	205,719.03

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。

#### 6.4.7.24 分部报告

无。

#### 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，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 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。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 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

无。

##### 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
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

注：下述关联方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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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	37,721,699.35	100.00	17,631,964.56	100.00

#### 6.4.10.1.2 债券交易

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交易。

#### 6.4.10.1.3 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。

#### 6.4.10.1.4 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。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30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	28,136.83	100.00	11,081.09	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30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	12,894.50	100.00	9,771.59	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、因我司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，我司旗下公募基金参与证券交易仅能使用我司自有交易席位进行，暂不能使用其他证券公司的交易席位进行证券交易。

#### 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 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	47,262.26	46,704.76
其中：应支付销售机构的客户维护 费	21.62	130.97

应支付基金管理人的净管理费	47,240.64	46,573.79
---------------	-----------	-----------

注：支付基金管理人中银证券的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	15,754.11	15,568.27

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。其计算公式为：

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

#### 6.4.10.2.3 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。

#### 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

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。

#### 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

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。

##### 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

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。

#### 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

注：本基金的基金管理人于本基金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。

##### 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 2024年6月30日	上年度末 2023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	54,151,380.00	91.0626	49,501,780.00	89.2500

#### 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

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30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	838,160.17	1,293.42	627,752.59	896.36

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。

#### 6.4.10.7 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。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于2024年6月30日，本基金持有16,700.00股中银证券的普通股，成本总额为人民币201,545.02元，估值总额为人民币151,636.00元，占基金净资产的比例为0.25%(2023年6月30日，本基金持有15,300.00股中银证券的普通股，成本总额为人民币198,977.41元，估值总额为人民币163,098.00元，占基金净资产的比例为0.26%)。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2024年6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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.2 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
113685	升24转债	2024年6月14日	1-6个月(含)	新债未上市	100.00	100.01	110	11,000.00	11,000.82	-

##### 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	停牌	停牌	期末	复牌	复牌	数量	期末	期末	备注
------	----	----	----	----	----	----	----	----	----	----

码	名称	日期	原因	估值 单价	日期	开盘单 价	(股)	成本总额	估值 总额	
400174	中天 3	2023 年 8 月 30 日	暂停转 让	0.00	-	-	44,600	126,944.97	0.00	

#### 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

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。

##### 6.4.12.3.2 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

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 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。

##### 6.4.13.1 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、执行委员会、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。执行委员会领导公司基金业务的风险管理。风险管理委员会协助执行委员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。

#### 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。

##### 6.4.13.2.1 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。

##### 6.4.13.2.2 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。

##### 6.4.13.2.3 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。

##### 6.4.13.2.4 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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	11,000.82	-
未评级	-	-
合计	11,000.82	-



#### 6.4.13.2.5 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。

#### 6.4.13.2.6 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。

#### 6.4.13.3 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 2024 年 6 月 30 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。

##### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：不适用。

##### 6.4.13.3.2 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 2024 年 6 月 30 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 2024 年 6 月 30 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。

#### 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的利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为货币资金、结算备付金和存出保证金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	838,160.17	-	-	-	838,160.17
结算备付金	654.52	-	-	-	654.52
存出保证金	8,309.89	-	-	-	8,309.89
交易性金融资产	11,000.82	-	-	59,849,039.75	59,860,040.57
其他资产	-	-	-	75,409.12	75,409.12
资产总计	858,125.40	-	-	59,924,448.87	60,782,574.27
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	7,495.75	7,495.75
应付托管费	-	-	-	2,498.58	2,498.58
应付清算款	-	-	-	251,981.15	251,981.15
其他负债	-	-	-	114,167.46	114,167.46
负债总计	-	-	-	376,142.94	376,142.94
利率敏感度缺口	858,125.40	-	-	59,548,305.93	60,406,431.33
上年度末 2023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	678,817.35	-	-	-	678,817.35
结算备付金	2,024.20	-	-	-	2,024.20

存出保证金	1,070.23	-	-	-	1,070.23
交易性金融资产	-	-	-	60,692,263.02	60,692,263.02
应收清算款	-	-	-	110,692.39	110,692.39
资产总计	681,911.78	-	-	60,802,955.41	61,484,867.19
负债	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	7,556.10	7,556.10
应付托管费	-	-	-	2,518.70	2,518.70
其他负债	-	-	-	257,681.67	257,681.67
负债总计	-	-	-	267,756.47	267,756.47
利率敏感度缺口	681,911.78	-	-	60,535,198.94	61,217,110.72

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

注：于 2024 年 6 月 30 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 0.02%（2023 年 12 月 31 日：0.00%），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（2023 年 12 月 31 日：同）。

#### 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。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：不适用。

##### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：不适用。

#### 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。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分股及其备选成分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。

#### 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 2024年6月30日		上年度末 2023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	59,849,039.75	99.08	60,692,263.02	99.14
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	59,849,039.75	99.08	60,692,263.02	99.14

#### 6.4.13.4.3.2 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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	2,986,557.70	3,033,882.98
	业绩比较基准下降5%	-2,986,557.70	-3,033,882.98

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：不适用。

## 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	59,849,039.75	60,692,263.02
第二层次	11,000.82	-
第三层次	-	-
合计	59,860,040.57	60,692,263.02

#### 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。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2023 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.14.4 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。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 基金申购款

于 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间，本基金申购基金份额的对价总额为 23,357,399.30 元(于 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间: 2,415,640.44 元)，其中包括以股票支付的申购款 10,748,406.00 元和以现金支付的申购款 12,608,993.30 元(于 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间: 其中包括以股票支付的申购款 1,207,446.00 元和以现金支付的申购款 1,208,194.44 元)。

(2) 除基金申购款外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	59,849,039.75	98.46
	其中：股票	59,849,039.75	98.46
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	11,000.82	0.02
	其中：债券	11,000.82	0.02
	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	838,814.69	1.38
8	其他各项资产	83,719.01	0.14
9	合计	60,782,574.27	100.00

### 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	375,141.00	0.62
B	采矿业	2,797,437.00	4.63
C	制造业	37,852,731.18	62.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,412,768.90	3.99
E	建筑业	610,227.00	1.01
F	批发和零售业	1,274,298.40	2.11
G	交通运输、仓储和	1,203,474.00	1.99

	邮政业		
H	住宿和餐饮业	188,453.00	0.31
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,262,962.64	7.06
J	金融业	5,542,611.12	9.18
K	房地产业	677,764.00	1.12
L	租赁和商务服务业	457,875.00	0.76
M	科学研究和技术服务业	476,623.01	0.79
N	水利、环境和公共设施管理业	271,833.50	0.45
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	66,096.00	0.11
Q	卫生和社会工作	371,695.00	0.62
R	文化、体育和娱乐业	900,059.00	1.49
S	综合	107,008.00	0.18
	合计	59,849,057.75	99.08

### 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

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	-	-

### 7.2.3 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	300502	新易盛	7,200	759,960.00	1.26
2	002028	思源电气	6,200	414,780.00	0.69
3	601058	赛轮轮胎	26,600	372,400.00	0.62
4	688169	石头科技	893	350,591.80	0.58
5	600066	宇通客车	13,400	345,720.00	0.57
6	002340	格林美	51,900	330,603.00	0.55
7	000933	神火股份	15,900	321,657.00	0.53
8	000988	华工科技	10,200	305,286.00	0.51
9	601168	西部矿业	16,800	301,560.00	0.50
10	300394	天孚通信	3,380	298,859.60	0.49
11	601077	渝农商行	58,900	295,678.00	0.49
12	000423	东阿阿胶	4,600	287,960.00	0.48
13	002384	东山精密	13,800	285,660.00	0.47
14	000630	铜陵有色	77,500	279,775.00	0.46
15	600418	江淮汽车	17,600	278,784.00	0.46
16	600988	赤峰黄金	16,800	274,512.00	0.45
17	601233	桐昆股份	17,000	271,320.00	0.45
18	002625	光启技术	15,200	263,720.00	0.44
19	600157	永泰能源	223,300	263,494.00	0.44
20	600096	云天化	13,000	252,460.00	0.42
21	601567	三星医疗	7,100	248,500.00	0.41
22	000400	许继电气	7,200	247,752.00	0.41
23	002156	通富微电	10,700	239,573.00	0.40
24	002128	电投能源	11,300	238,430.00	0.39
25	002273	水晶光电	14,000	237,720.00	0.39
26	688777	中控技术	6,300	237,510.00	0.39
27	601555	东吴证券	40,150	236,885.00	0.39
28	002078	太阳纸业	16,900	235,755.00	0.39
29	600885	宏发股份	8,380	231,958.40	0.38



30	601128	常熟银行	30,410	230,203.70	0.38
31	002223	鱼跃医疗	6,100	229,360.00	0.38
32	002532	天山铝业	28,200	228,702.00	0.38
33	688617	惠泰医疗	500	228,050.00	0.38
34	300207	欣旺达	15,000	227,550.00	0.38
35	600352	浙江龙盛	26,300	225,917.00	0.37
36	600398	海澜之家	24,300	224,532.00	0.37
37	002966	苏州银行	29,670	222,525.00	0.37
38	002138	顺络电子	8,100	222,426.00	0.37
39	002353	杰瑞股份	6,200	217,496.00	0.36
40	601108	财通证券	32,800	216,808.00	0.36
41	600765	中航重机	10,520	214,608.00	0.36
42	002185	华天科技	25,900	211,085.00	0.35
43	688099	晶晨股份	3,500	207,620.00	0.34
44	600879	航天电子	26,700	207,459.00	0.34
45	002517	恺英网络	21,700	207,235.00	0.34
46	603606	东方电缆	4,200	205,002.00	0.34
47	301236	软通动力	5,800	204,218.00	0.34
48	600873	梅花生物	20,200	202,404.00	0.34
49	600177	雅戈尔	28,100	200,072.00	0.33
50	601577	长沙银行	24,400	199,592.00	0.33
51	002738	中矿资源	7,420	198,856.00	0.33
52	600109	国金证券	26,200	197,810.00	0.33
53	600079	人福医药	11,500	197,455.00	0.33
54	300003	乐普医疗	13,300	197,372.00	0.33
55	600060	海信视像	7,900	195,446.00	0.32
56	300017	网宿科技	24,700	195,130.00	0.32
57	603160	汇顶科技	2,800	192,500.00	0.32
58	600497	驰宏锌锗	36,000	192,240.00	0.32
59	300136	信维通信	9,800	191,884.00	0.32
60	002202	金风科技	27,900	187,488.00	0.31
61	603979	金诚信	3,700	186,961.00	0.31
62	002739	万达电影	15,400	186,186.00	0.31
63	000932	华菱钢铁	41,900	185,617.00	0.31
64	689009	九号公司	5,000	184,050.00	0.30
65	600985	淮北矿业	10,900	182,466.00	0.30
66	002409	雅克科技	2,900	182,439.00	0.30
67	000683	远兴能源	26,400	182,424.00	0.30
68	002465	海格通信	17,500	181,300.00	0.30
69	600348	华阳股份	18,200	181,272.00	0.30
70	600536	中国软件	6,049	180,986.08	0.30
71	002444	巨星科技	7,300	180,310.00	0.30
72	688122	西部超导	4,700	180,104.00	0.30

73	002281	光迅科技	4,800	179,376.00	0.30
74	000009	中国宝安	20,800	178,880.00	0.30
75	300474	景嘉微	2,800	177,044.00	0.29
76	000878	云南铜业	14,200	176,932.00	0.29
77	002008	大族激光	8,500	176,800.00	0.29
78	002436	兴森科技	17,100	176,472.00	0.29
79	600642	申能股份	19,800	174,834.00	0.29
80	601615	明阳智能	18,400	173,696.00	0.29
81	002797	第一创业	34,000	173,060.00	0.29
82	000039	中集集团	18,650	172,699.00	0.29
83	300054	鼎龙股份	7,600	172,368.00	0.29
84	601990	南京证券	22,300	171,264.00	0.28
85	300012	华测检测	17,000	171,020.00	0.28
86	000066	中国长城	19,500	170,625.00	0.28
87	688120	华海清科	900	170,622.00	0.28
88	600298	安琪酵母	6,100	170,373.00	0.28
89	600529	山东药玻	6,700	169,778.00	0.28
90	601666	平煤股份	15,000	168,000.00	0.28
91	002673	西部证券	27,100	167,749.00	0.28
92	600839	四川长虹	37,300	167,477.00	0.28
93	603596	伯特利	4,300	167,270.00	0.28
94	601179	中国西电	20,700	166,428.00	0.28
95	300395	菲利华	5,300	162,975.00	0.27
96	000831	中国稀土	6,400	162,240.00	0.27
97	002432	九安医疗	4,000	162,160.00	0.27
98	000783	长江证券	33,500	161,805.00	0.27
99	603816	顾家家居	5,000	161,450.00	0.27
100	601717	郑煤机	10,900	161,320.00	0.27
101	300002	神州泰岳	19,800	160,776.00	0.27
102	688525	佰维存储	2,500	160,375.00	0.27
103	688188	柏楚电子	868	160,189.40	0.27
104	000728	国元证券	26,400	159,984.00	0.26
105	000738	航发控制	7,900	158,553.00	0.26
106	000703	恒逸石化	22,200	157,398.00	0.26
107	603338	浙江鼎力	2,600	157,092.00	0.26
108	688180	君实生物	5,374	156,114.70	0.26
109	603345	安井食品	2,100	156,051.00	0.26
110	601198	东兴证券	19,600	156,016.00	0.26
111	600862	中航高科	8,300	155,874.00	0.26
112	601997	贵阳银行	29,500	155,465.00	0.26
113	000960	锡业股份	10,000	154,900.00	0.26
114	002155	湖南黄金	8,500	153,850.00	0.25
115	600863	内蒙华电	33,000	153,120.00	0.25

116	002595	豪迈科技	4,000	152,680.00	0.25
117	600038	中直股份	3,700	152,107.00	0.25
118	601162	天风证券	69,700	151,946.00	0.25
119	600521	华海药业	8,900	151,745.00	0.25
120	601696	中银证券	16,700	151,636.00	0.25
121	000921	海信家电	4,700	151,528.00	0.25
122	603939	益丰药房	6,172	151,522.60	0.25
123	300037	新宙邦	5,300	151,368.00	0.25
124	300724	捷佳伟创	2,800	151,228.00	0.25
125	300001	特锐德	7,500	150,900.00	0.25
126	002472	双环传动	6,800	149,736.00	0.25
127	300866	安克创新	2,100	149,541.00	0.25
128	002984	森麒麟	6,200	149,358.00	0.25
129	002294	信立泰	5,600	149,128.00	0.25
130	600141	兴发集团	7,800	148,824.00	0.25
131	600549	厦门钨业	8,600	148,350.00	0.25
132	600699	均胜电子	10,000	148,200.00	0.25
133	002407	多氟多	12,100	147,983.00	0.24
134	600546	山煤国际	10,000	146,200.00	0.24
135	300699	光威复材	5,880	146,000.40	0.24
136	002850	科达利	1,900	145,122.00	0.24
137	600820	隧道股份	22,200	144,966.00	0.24
138	002262	恩华药业	6,100	144,814.00	0.24
139	301358	湖南裕能	4,600	144,716.00	0.24
140	300285	国瓷材料	8,100	144,585.00	0.24
141	600369	西南证券	40,300	144,274.00	0.24
142	600895	张江高科	7,800	144,144.00	0.24
143	002195	岩山科技	57,400	144,074.00	0.24
144	000021	深科技	9,500	143,640.00	0.24
145	002064	华峰化学	20,000	143,400.00	0.24
146	600872	中炬高新	6,300	142,947.00	0.24
147	600486	扬农化工	2,510	141,689.50	0.23
148	603589	口子窖	3,600	141,084.00	0.23
149	300073	当升科技	4,100	140,671.00	0.23
150	601000	唐山港	29,900	140,530.00	0.23
151	600021	上海电力	14,200	140,438.00	0.23
152	300146	汤臣倍健	10,300	139,565.00	0.23
153	603087	甘李药业	3,000	138,960.00	0.23
154	000513	丽珠集团	3,700	137,677.00	0.23
155	600704	物产中大	31,500	136,710.00	0.23
156	300058	蓝色光标	25,100	136,544.00	0.23
157	002756	永兴材料	3,800	135,964.00	0.23
158	601966	玲珑轮胎	7,400	135,938.00	0.23

159	300114	中航电测	3,000	135,750.00	0.22
160	600153	建发股份	15,200	135,736.00	0.22
161	600155	华创云信	22,843	135,002.13	0.22
162	000830	鲁西化工	11,600	134,444.00	0.22
163	603179	新泉股份	3,400	133,416.00	0.22
164	600118	中国卫星	6,000	133,380.00	0.22
165	300529	健帆生物	4,900	133,329.00	0.22
166	002558	巨人网络	14,000	132,160.00	0.22
167	600583	海油工程	22,300	131,793.00	0.22
168	002152	广电运通	12,500	130,750.00	0.22
169	601156	东航物流	6,400	130,240.00	0.22
170	000591	太阳能	27,600	129,996.00	0.22
171	000623	吉林敖东	9,700	129,980.00	0.22
172	002025	航天电器	2,800	129,864.00	0.21
173	600970	中材国际	10,700	129,042.00	0.21
174	300373	扬杰科技	3,300	128,370.00	0.21
175	002385	大北农	33,200	127,820.00	0.21
176	002439	启明星辰	7,400	127,724.00	0.21
177	300144	宋城演艺	15,900	127,677.00	0.21
178	688065	凯赛生物	2,800	127,092.00	0.21
179	600380	健康元	11,300	126,221.00	0.21
180	601216	君正集团	34,100	125,829.00	0.21
181	000729	燕京啤酒	14,200	125,386.00	0.21
182	605358	立昂微	5,400	124,956.00	0.21
183	600143	金发科技	18,900	124,929.00	0.21
184	000723	美锦能源	26,200	124,712.00	0.21
185	300251	光线传媒	14,800	124,468.00	0.21
186	600998	九州通	25,489	124,386.32	0.21
187	600763	通策医疗	2,300	124,315.00	0.21
188	600637	东方明珠	20,400	124,032.00	0.21
189	600282	南钢股份	24,900	124,002.00	0.21
190	000519	中兵红箭	8,400	123,228.00	0.20
191	600516	方大炭素	28,500	122,835.00	0.20
192	300383	光环新网	14,500	122,525.00	0.20
193	600392	盛和资源	14,200	122,404.00	0.20
194	300024	机器人	12,500	121,750.00	0.20
195	300677	英科医疗	4,540	121,717.40	0.20
196	000636	风华高科	9,300	121,458.00	0.20
197	000818	航锦科技	5,500	121,440.00	0.20
198	002958	青农商行	44,900	120,332.00	0.20
199	601665	齐鲁银行	24,400	119,804.00	0.20
200	002044	美年健康	31,600	119,448.00	0.20
201	600008	首创环保	44,510	119,286.80	0.20

202	000883	湖北能源	19,800	118,998.00	0.20
203	600566	济川药业	3,700	117,327.00	0.19
204	000629	钒钛股份	46,900	117,250.00	0.19
205	600867	通化东宝	14,000	117,180.00	0.19
206	601016	节能风电	39,190	117,178.10	0.19
207	600511	国药股份	3,800	117,002.00	0.19
208	600909	华安证券	27,790	116,995.90	0.19
209	601456	国联证券	12,100	116,644.00	0.19
210	300088	长信科技	24,800	116,560.00	0.19
211	600170	上海建工	53,900	115,885.00	0.19
212	000997	新大陆	8,300	115,453.00	0.19
213	600582	天地科技	16,700	115,063.00	0.19
214	600499	科达制造	13,600	114,648.00	0.19
215	600498	烽火通信	7,200	114,480.00	0.19
216	600535	天士力	9,100	114,478.00	0.19
217	600004	白云机场	12,000	113,760.00	0.19
218	601933	永辉超市	45,800	113,584.00	0.19
219	000598	兴蓉环境	15,100	113,552.00	0.19
220	601991	大唐发电	37,600	113,176.00	0.19
221	300567	精测电子	2,000	113,020.00	0.19
222	002120	韵达股份	14,600	113,004.00	0.19
223	600580	卧龙电驱	9,300	112,995.00	0.19
224	600129	太极集团	3,900	112,788.00	0.19
225	000750	国海证券	38,700	112,617.00	0.19
226	603000	人民网	5,600	111,944.00	0.19
227	000060	中金岭南	26,400	111,936.00	0.19
228	002261	拓维信息	10,100	111,807.00	0.19
229	688213	思特威	2,300	111,550.00	0.18
230	300568	星源材质	13,600	111,520.00	0.18
231	300118	东方日升	9,200	111,320.00	0.18
232	002430	杭氧股份	5,000	111,250.00	0.18
233	603658	安图生物	2,400	110,568.00	0.18
234	002429	兆驰股份	22,900	110,149.00	0.18
235	002939	长城证券	16,300	109,210.00	0.18
236	600166	福田汽车	48,500	109,125.00	0.18
237	600325	华发股份	16,700	108,550.00	0.18
238	603486	科沃斯	2,300	108,514.00	0.18
239	300765	新诺威	4,300	108,489.00	0.18
240	603156	养元饮品	5,100	108,477.00	0.18
241	603228	景旺电子	3,400	108,120.00	0.18
242	601231	环旭电子	6,700	107,535.00	0.18
243	603927	中科软	5,916	107,020.44	0.18
244	600673	东阳光	15,200	107,008.00	0.18

245	000893	亚钾国际	6,600	106,656.00	0.18
246	600563	法拉电子	1,400	106,652.00	0.18
247	600816	建元信托	39,300	106,503.00	0.18
248	300487	蓝晓科技	2,550	106,488.00	0.18
249	603568	伟明环保	5,160	106,192.80	0.18
250	300601	康泰生物	6,800	106,148.00	0.18
251	002508	老板电器	4,800	106,080.00	0.18
252	600754	锦江酒店	4,600	105,708.00	0.17
253	601636	旗滨集团	16,300	105,135.00	0.17
254	000027	深圳能源	14,400	105,120.00	0.17
255	002926	华西证券	15,900	104,781.00	0.17
256	002653	海思科	3,400	104,380.00	0.17
257	000998	隆平高科	10,600	104,198.00	0.17
258	002624	完美世界	13,700	104,120.00	0.17
259	603298	杭叉集团	5,300	104,092.00	0.17
260	600737	中粮糖业	10,800	103,572.00	0.17
261	688385	复旦微电	3,300	103,554.00	0.17
262	688002	睿创微纳	3,700	103,489.00	0.17
263	002497	雅化集团	11,600	103,472.00	0.17
264	603290	斯达半导	1,200	103,332.00	0.17
265	300253	卫宁健康	17,500	103,250.00	0.17
266	300604	长川科技	3,800	103,246.00	0.17
267	601866	中远海发	40,000	103,200.00	0.17
268	600131	国网信通	6,100	102,907.00	0.17
269	002065	东华软件	22,700	102,604.00	0.17
270	603077	和邦生物	62,100	102,465.00	0.17
271	002299	圣农发展	7,500	102,300.00	0.17
272	002056	横店东磁	8,200	102,254.00	0.17
273	688052	纳芯微	994	102,163.32	0.17
274	601958	金钼股份	9,800	102,018.00	0.17
275	002414	高德红外	17,300	101,897.00	0.17
276	300390	天华新能	5,910	101,533.80	0.17
277	600655	豫园股份	19,700	101,455.00	0.17
278	300009	安科生物	11,856	101,250.24	0.17
279	688772	珠海冠宇	6,779	101,007.10	0.17
280	600373	中文传媒	6,800	100,912.00	0.17
281	603893	瑞芯微	1,700	100,589.00	0.17
282	002500	山西证券	21,330	100,251.00	0.17
283	300763	锦浪科技	2,400	99,936.00	0.17
284	002368	太极股份	4,419	99,648.45	0.16
285	002507	涪陵榨菜	8,110	99,347.50	0.16
286	688390	固德威	1,770	99,332.40	0.16
287	600707	彩虹股份	14,500	98,745.00	0.16

288	601611	中国核建	12,200	98,698.00	0.16
289	002372	伟星新材	6,400	98,688.00	0.16
290	000887	中鼎股份	8,000	97,920.00	0.16
291	603885	吉祥航空	8,900	97,811.00	0.16
292	002831	裕同科技	3,800	97,242.00	0.16
293	603225	新凤鸣	6,200	96,658.00	0.16
294	002203	海亮股份	12,100	96,558.00	0.16
295	688521	芯原股份	3,600	96,300.00	0.16
296	603379	三美股份	2,460	96,284.40	0.16
297	600755	厦门国贸	13,400	96,078.00	0.16
298	600329	达仁堂	2,900	93,931.00	0.16
299	600859	王府井	8,000	93,920.00	0.16
300	600995	南网储能	9,700	93,702.00	0.16
301	600801	华新水泥	6,800	93,500.00	0.15
302	600416	湘电股份	9,400	93,436.00	0.15
303	688114	华大智造	1,969	93,350.29	0.15
304	601880	辽港股份	75,700	93,111.00	0.15
305	002683	广东宏大	4,600	92,598.00	0.15
306	600884	杉杉股份	11,400	92,568.00	0.15
307	300070	碧水源	22,000	92,180.00	0.15
308	600390	五矿资本	22,700	91,935.00	0.15
309	300296	利亚德	20,400	91,800.00	0.15
310	002506	协鑫集成	47,300	91,762.00	0.15
311	002244	滨江集团	12,600	91,476.00	0.15
312	002019	亿帆医药	7,400	91,464.00	0.15
313	600435	北方导航	10,600	91,372.00	0.15
314	300803	指南针	2,500	91,025.00	0.15
315	600483	福能股份	7,800	90,948.00	0.15
316	601098	中南传媒	7,300	90,666.00	0.15
317	600739	辽宁成大	10,800	90,396.00	0.15
318	000050	深天马 A	12,400	90,272.00	0.15
319	300748	金力永磁	6,940	89,942.40	0.15
320	600598	北大荒	7,200	89,928.00	0.15
321	600399	抚顺特钢	15,900	89,517.00	0.15
322	601598	中国外运	15,900	89,517.00	0.15
323	600901	江苏金租	17,700	89,385.00	0.15
324	002487	大金重工	3,900	89,232.00	0.15
325	002568	百润股份	5,300	89,199.00	0.15
326	002572	索菲亚	5,800	88,914.00	0.15
327	600848	上海临港	9,700	88,367.00	0.15
328	000155	川能动力	8,200	88,314.00	0.15
329	002080	中材科技	6,800	87,720.00	0.15
330	001286	陕西能源	7,600	87,628.00	0.15

331	300676	华大基因	2,500	87,525.00	0.14
332	002557	洽洽食品	3,100	87,389.00	0.14
333	002240	盛新锂能	6,500	87,230.00	0.14
334	002373	千方科技	9,600	87,072.00	0.14
335	002936	郑州银行	49,963	86,435.99	0.14
336	603712	七一二	4,700	85,493.00	0.14
337	002268	电科网安	6,000	85,380.00	0.14
338	000563	陕国投 A	31,000	85,250.00	0.14
339	603883	老百姓	4,643	85,245.48	0.14
340	603858	步长制药	5,600	84,840.00	0.14
341	300595	欧普康视	5,400	84,672.00	0.14
342	600968	海油发展	20,500	84,460.00	0.14
343	601928	凤凰传媒	7,700	84,392.00	0.14
344	688234	天岳先进	1,773	83,189.16	0.14
345	000778	新兴铸管	23,900	83,172.00	0.14
346	688538	和辉光电	42,000	83,160.00	0.14
347	601212	白银有色	29,900	83,122.00	0.14
348	600258	首旅酒店	6,700	82,745.00	0.14
349	600271	航天信息	11,200	82,432.00	0.14
350	600062	华润双鹤	4,200	82,236.00	0.14
351	688017	绿的谐波	1,000	82,100.00	0.14
352	600528	中铁工业	11,200	81,984.00	0.14
353	688536	思瑞浦	835	81,671.35	0.14
354	688301	奕瑞科技	708	81,582.84	0.14
355	688005	容百科技	3,500	81,480.00	0.13
356	300558	贝达药业	2,500	81,375.00	0.13
357	002531	天顺风能	9,100	81,354.00	0.13
358	000709	河钢股份	41,800	81,092.00	0.13
359	600378	昊华科技	2,800	80,920.00	0.13
360	601155	新城控股	9,100	80,717.00	0.13
361	600977	中国电影	7,500	80,700.00	0.13
362	002408	齐翔腾达	14,400	80,640.00	0.13
363	000739	普洛药业	5,900	80,063.00	0.13
364	600959	江苏有线	30,300	79,992.00	0.13
365	603688	石英股份	2,700	79,947.00	0.13
366	601118	海南橡胶	17,300	78,715.00	0.13
367	603737	三棵树	2,160	78,343.20	0.13
368	688220	翱捷科技	2,086	78,141.56	0.13
369	000825	太钢不锈	23,100	78,078.00	0.13
370	600056	中国医药	7,600	76,912.00	0.13
371	603882	金域医学	2,800	76,132.00	0.13
372	600612	老凤祥	1,300	75,647.00	0.13
373	603456	九洲药业	5,500	75,460.00	0.12



374	000987	越秀资本	15,190	75,342.40	0.12
375	601399	国机重装	29,100	75,078.00	0.12
376	600906	财达证券	13,100	75,063.00	0.12
377	600517	国网英大	17,300	74,909.00	0.12
378	601019	山东出版	6,300	74,466.00	0.12
379	300212	易华录	4,380	73,715.40	0.12
380	002266	浙富控股	26,330	73,460.70	0.12
381	688331	荣昌生物	1,700	73,440.00	0.12
382	000937	冀中能源	10,700	71,690.00	0.12
383	600871	石化油服	41,100	71,514.00	0.12
384	600316	洪都航空	4,300	71,509.00	0.12
385	603444	吉比特	400	71,204.00	0.12
386	603529	爱玛科技	2,600	71,058.00	0.12
387	688567	孚能科技	7,400	71,040.00	0.12
388	603650	彤程新材	2,400	70,920.00	0.12
389	600925	苏能股份	13,900	70,195.00	0.12
390	002423	中粮资本	9,300	69,657.00	0.12
391	688200	华峰测控	758	69,546.50	0.12
392	601965	中国汽研	4,100	69,249.00	0.11
393	000032	深桑达 A	4,600	68,908.00	0.11
394	001227	兰州银行	28,800	68,544.00	0.11
395	688032	禾迈股份	596	68,408.88	0.11
396	603728	鸣志电器	1,700	68,391.00	0.11
397	600208	新湖中宝	43,000	67,940.00	0.11
398	601298	青岛港	7,100	67,876.00	0.11
399	600098	广州发展	10,600	67,840.00	0.11
400	688063	派能科技	1,680	66,712.80	0.11
401	601608	中信重工	17,500	66,675.00	0.11
402	600663	陆家嘴	7,500	66,150.00	0.11
403	688561	奇安信	2,800	66,136.00	0.11
404	002607	中公教育	43,200	66,096.00	0.11
405	002670	国盛金控	7,800	66,066.00	0.11
406	688297	中无人机	2,000	66,060.00	0.11
407	300438	鹏辉能源	3,600	66,024.00	0.11
408	603233	大参林	4,610	65,923.00	0.11
409	600578	京能电力	20,300	65,772.00	0.11
410	600022	山东钢铁	53,400	65,148.00	0.11
411	300357	我武生物	3,200	64,704.00	0.11
412	688516	奥特维	1,543	64,512.83	0.11
413	601106	中国一重	27,700	63,987.00	0.11
414	300776	帝尔激光	1,380	63,424.80	0.10
415	600500	中化国际	18,100	63,169.00	0.10
416	600377	宁沪高速	5,000	63,000.00	0.10

417	003031	中瓷电子	1,340	61,961.60	0.10
418	600967	内蒙一机	8,600	61,920.00	0.10
419	000785	居然之家	25,400	61,722.00	0.10
420	002865	钧达股份	1,600	61,408.00	0.10
421	600315	上海家化	3,400	60,452.00	0.10
422	300888	稳健医疗	2,380	60,214.00	0.10
423	600350	山东高速	6,800	60,180.00	0.10
424	000537	中绿电	6,300	60,039.00	0.10
425	600827	百联股份	8,100	59,778.00	0.10
426	000958	电投产融	16,300	59,658.00	0.10
427	601568	北元集团	16,070	59,619.70	0.10
428	688349	三一重能	2,400	59,616.00	0.10
429	688425	铁建重工	16,200	59,616.00	0.10
430	000559	万向钱潮	13,300	59,318.00	0.10
431	000156	华数传媒	9,400	59,032.00	0.10
432	002608	江苏国信	7,600	58,900.00	0.10
433	603517	绝味食品	3,800	58,520.00	0.10
434	002690	美亚光电	3,540	58,410.00	0.10
435	603707	健友股份	4,861	57,748.68	0.10
436	002867	周大生	4,400	57,464.00	0.10
437	601992	金隅集团	41,900	57,403.00	0.10
438	603826	坤彩科技	1,960	56,781.20	0.09
439	300682	朗新集团	6,600	56,166.00	0.09
440	600126	杭钢股份	13,600	55,896.00	0.09
441	688029	南微医学	900	55,404.00	0.09
442	688520	神州细胞	1,401	55,129.35	0.09
443	003022	联泓新科	4,000	54,840.00	0.09
444	000967	盈峰环境	12,800	54,144.00	0.09
445	603218	XD 日月股	5,200	53,404.00	0.09
446	600032	浙江新能	7,300	53,144.00	0.09
447	600481	双良节能	11,300	52,771.00	0.09
448	600339	中油工程	16,900	52,728.00	0.09
449	600361	创新新材	12,900	51,987.00	0.09
450	600095	湘财股份	8,700	51,852.00	0.09
451	301267	华夏眼科	2,500	51,800.00	0.09
452	688778	厦钨新能	1,654	51,670.96	0.09
453	603786	科博达	800	51,320.00	0.08
454	000898	鞍钢股份	24,200	51,304.00	0.08
455	688475	萤石网络	1,500	51,165.00	0.08
456	603127	昭衍新药	3,832	50,850.64	0.08
457	003035	南网能源	11,500	50,600.00	0.08
458	600808	马钢股份	24,300	49,086.00	0.08
459	002563	森马服饰	8,200	47,642.00	0.08

460	688248	南网科技	1,599	47,378.37	0.08
461	002153	石基信息	8,240	47,215.20	0.08
462	601228	广州港	15,200	46,360.00	0.08
463	603185	弘元绿能	2,700	46,143.00	0.08
464	000539	粤电力 A	9,000	45,720.00	0.08
465	688779	长远锂科	9,700	44,911.00	0.07
466	001872	招商港口	2,300	44,275.00	0.07
467	001203	大中矿业	4,600	44,206.00	0.07
468	600928	西安银行	13,500	44,145.00	0.07
469	000401	冀东水泥	10,700	43,442.00	0.07
470	600764	中国海防	2,200	43,186.00	0.07
471	688281	华秦科技	514	42,826.48	0.07
472	000959	首钢股份	15,700	42,704.00	0.07
473	002518	科士达	2,400	42,480.00	0.07
474	688006	杭可科技	2,379	41,513.55	0.07
475	603056	德邦股份	3,100	40,610.00	0.07
476	603305	旭升集团	3,800	40,128.00	0.07
477	600299	安迪苏	4,100	39,770.00	0.07
478	601139	深圳燃气	5,800	38,744.00	0.06
479	688172	燕东微	2,300	37,214.00	0.06
480	603317	天味食品	3,256	37,150.96	0.06
481	300861	美畅股份	1,900	36,765.00	0.06
482	688375	国博电子	500	35,320.00	0.06
483	301029	怡合达	1,780	34,994.80	0.06
484	688387	信科移动	6,800	34,272.00	0.06
485	688276	百克生物	1,202	34,100.74	0.06
486	002791	坚朗五金	1,300	33,631.00	0.06
487	600927	永安期货	2,900	32,335.00	0.05
488	688819	天能股份	1,300	31,018.00	0.05
489	601858	中国科传	1,600	30,592.00	0.05
490	688107	安路科技	1,203	30,580.26	0.05
491	000031	大悦城	13,000	30,420.00	0.05
492	688153	唯捷创芯	800	29,600.00	0.05
493	601158	重庆水务	5,800	27,840.00	0.05
494	601828	美凯龙	10,900	27,795.00	0.05
495	002945	华林证券	2,700	26,946.00	0.04
496	600956	新天绿能	3,100	25,327.00	0.04
497	688348	昱能科技	400	23,600.00	0.04
498	301165	锐捷网络	700	20,888.00	0.03
499	603868	飞科电器	500	19,200.00	0.03
500	688295	中复神鹰	938	19,041.40	0.03

### 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

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

#### 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	688777	中控技术	259,644.00	0.42
2	601567	三星医疗	232,715.00	0.38
3	688617	惠泰医疗	222,006.14	0.36
4	002202	金风科技	209,418.00	0.34
5	002436	兴森科技	195,043.00	0.32
6	601615	明阳智能	191,647.00	0.31
7	301358	湖南裕能	185,967.00	0.30
8	603979	金诚信	185,244.00	0.30
9	300002	神州泰岳	181,404.00	0.30
10	000921	海信家电	179,205.00	0.29
11	300054	鼎龙股份	175,542.00	0.29
12	300502	新易盛	175,387.00	0.29
13	603345	安井食品	160,931.00	0.26
14	600872	中炬高新	159,811.00	0.26
15	002984	森麒麟	155,428.00	0.25
16	300394	天孚通信	154,053.00	0.25
17	000423	东阿阿胶	144,408.00	0.24
18	688525	佰维存储	141,945.00	0.23
19	002463	沪电股份	141,068.00	0.23
20	002422	科伦药业	140,781.00	0.23

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。

##### 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	002463	沪电股份	629,861.00	1.03
2	002422	科伦药业	511,288.00	0.84
3	000975	山金国际	438,033.20	0.72
4	300418	昆仑万维	404,348.00	0.66
5	600160	巨化股份	326,025.00	0.53
6	600161	天坛生物	257,957.00	0.42
7	600415	小商品城	224,968.00	0.37
8	688072	拓荆科技	209,795.65	0.34
9	600482	中国动力	199,008.00	0.33
10	300394	天孚通信	198,874.00	0.32

11	002600	领益智造	191,854.00	0.31
12	002032	苏泊尔	146,976.00	0.24
13	300866	安克创新	140,894.00	0.23
14	300502	新易盛	140,183.00	0.23
15	002966	苏州银行	139,862.00	0.23
16	002131	利欧股份	138,281.00	0.23
17	000423	东阿阿胶	130,978.00	0.21
18	002028	思源电气	122,124.00	0.20
19	000581	威孚高科	121,625.00	0.20
20	300144	宋城演艺	117,382.00	0.19

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。

#### 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	20,174,922.58
卖出股票收入（成交）总额	17,546,776.77

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。

#### 7.5 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）	11,000.82	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	11,000.82	0.02

#### 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

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	113685	升 24 转债	110	11,000.82	0.02

#### 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

**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**

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

**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**

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

**7.10 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期末未持有股指期货，无相关投资政策。

**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**

本基金投资范围未包括国债期货，无相关投资政策。

**7.11.2 本期国债期货投资评价**

本基金投资范围未包括国债期货。

**7.12 投资组合报告附注****7.12.1 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**

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、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。

**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	8,309.89
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	75,409.12
8	其他	-
9	合计	83,719.01

**7.12.4 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。

### 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

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。

#### 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

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

### 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

#### 8.1.1 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 (%)
379	156,902.59	55,289,780.00	92.98	4,176,300.00	7.02

#### 8.1.2 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	54,151,380.00	91.06

### 8.2 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	福州经济技术开发区 数为私募基金管理有 限公司—数为城盈套 利 1 号私募证券投资基 金	760,600.00	1.28
2	BARCLAYS BANK PLC	331,700.00	0.56
3	张建强	327,900.00	0.55
4	李劲松	326,400.00	0.55
5	刘英虹	250,000.00	0.42
6	曾雨清	187,000.00	0.31
7	龚俐	136,000.00	0.23
8	李向阳	130,000.00	0.22

9	王飞	102,700.00	0.17
10	胡汉明	100,500.00	0.17
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	54,151,380.00	91.06

### 8.3 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。

### 8.4 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 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	55,466,080.00
本报告期基金总申购份额	22,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	18,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	59,466,080.00

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 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

2024 年 4 月，董事艾富华先生因工作安排原因申请辞去公司董事、董事会风险控制委员会委员职务。2024 年 4 月，公司 2024 年第一次临时股东大会审议通过《关于选举公司第二届董事会非独立董事的议案》，选举沈金艳先生担任公司董事。

2024 年 6 月，董事王军先生因工作安排原因申请辞去公司董事、董事会风险控制委员会主任职务。2024 年 6 月，公司 2023 年年度股东大会审议通过《关于选举非独立董事的议案》，选举王晓卫先生担任公司董事。

2024 年 6 月，独立董事王娴女士因工作安排原因申请辞去公司独立董事、董事会薪酬与提



名委员会委员职务。2024 年 6 月，公司 2023 年年度股东大会审议通过《关于选举独立董事的议案》，选举江萍女士担任公司独立董事。

本报告期，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 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 2024 年半年度报告》；

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。

### 10.4 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。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，公司基金管理业务未有管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况，其他受处罚情况请参见《中银国际证券股份有限公司 2024 年半年度报告》。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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	37,721,699.35	100.00	28,136.83	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。

### 10.7.2 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	-	-	-	-	-	-

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。

## 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	中银国际证券股份有限公司旗下基金 2023 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	2024 年 1 月 19 日
2	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 1 月 19 日
3	中银国际证券股份有限公司旗下基金 2023 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	2024 年 3 月 29 日
4	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年年度报告	公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 3 月 29 日
5	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第一季度报告	公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 4 月 19 日
6	中银国际证券股份有限公司旗下基金 2024 年第一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	2024 年 4 月 19 日
7	关于增加上海攀赢基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构及参与其费率优惠活动的公告	规定报刊、上交所、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 6 月 12 日
8	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	公司官网、上交所及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 6 月 28 日

注：全部公告均在公司网站披露，部分公告在公司网站及报纸披露。

## § 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	20240101-20240630	49,501,780.00	4,750,300.00	100,700.00	54,151,380.00	91.06

#### 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。

## 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

### 12.2 存放地点

除第 6 项在基金托管人处外，其余文件均在基金管理人的住所。

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

中银国际证券股份有限公司

2024 年 8 月 31 日