

汇安中证 A500 指数证券投资基金

2025 年中期报告

2025 年 06 月 30 日

基金管理人:汇安基金管理有限责任公司

基金托管人:中国光大银行股份有限公司

送出日期:2025 年 08 月 30 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，并由董事长签发。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2025年8月29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2025年1月24日起至2025年6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	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
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	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 净资产变动表	19
6.4 报表附注.....	21
§7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况.....	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
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	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	65
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	67
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	67
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	67
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	67
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	67
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	68
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	68
7.12 投资组合报告附注.....	68
§8 基金份额持有人信息	69

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	69
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	69
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	70
§9 开放式基金份额变动	70
§10 重大事件揭示.....	71
10.1 基金份额持有人大会决议	71
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	71
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	71
10.4 基金投资策略的改变	71
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	71
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	71
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	72
10.8 其他重大事件	73
§11 影响投资者决策的其他重要信息	73
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	73
§12 备查文件目录.....	74
12.1 备查文件目录	74
12.2 存放地点	74
12.3 查阅方式	74

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇安中证A500指数证券投资基金	
基金简称	汇安中证A500指数	
基金主代码	023038	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025年01月24日	
基金管理人	汇安基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	85,852,158.15份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇安中证A500指数A	汇安中证A500指数C
下属分级基金的交易代码	023038	023039
报告期末下属分级基金的份额总额	3,520,865.92份	82,331,292.23份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用被动式指数化投资策略，紧密跟踪中证A500指数，力求实现对标的指数的跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金投资策略主要包括股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略等。
业绩比较基准	中证A500指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指类型基金，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		汇安基金管理有限责任公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	郭冬青	王茵
	联系电话	010-56711600	010-63639180
人	电子邮箱	guodq@huianfund.cn	wangyin@cebbank.com
客户服务电话		010-56711690	95595
传真		010-56711640	010-63639132
注册地址		上海市虹口区欧阳路218弄1号2楼215室	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
办公地址		北京市东城区东直门南大街5号中青旅大厦13层；上海市虹口区东大名路501号白玉兰大厦36层	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码		100007	100033
法定代表人		刘强	吴利军

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.huianfund.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	汇安基金管理有限责任公司	上海市虹口区东大名路501号上海白玉兰广场36层02单元

§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 (2025年01月24日(基金合同生效日)-2025年06月30日)	
	汇安中证A500指数 A	汇安中证A500指数 C
本期已实现收益	31,651.68	516,154.98
本期利润	98,469.09	839,624.31
加权平均基金份额本期利润	0.0141	0.0070
本期加权平均净值利润率	1.42%	0.71%
本期基金份额净值增长率	1.04%	0.93%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2025年06月30日)	
	25,619.46	511,042.75
期末可供分配利润	0.0073	0.0062
期末可供分配基金份额利润	3,557,408.48	83,096,248.11
期末基金资产净值	1.0104	1.0093
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2025年06月30日)	
	1.04%	0.93%
基金份额累计净值增长率		

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

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

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分余额的孰低数。

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

汇安中证A500指数A

阶段	份额净值	份额净值 增长率标	业绩比较 基准收益	业绩比较 基准收益	①-③	②-④
----	------	--------------	--------------	--------------	-----	-----

	增长率①	准差②	率③	率标准差 ④		
过去一个月	3.32%	0.56%	2.68%	0.57%	0.64%	-0.01%
过去三个月	2.52%	1.02%	0.83%	1.14%	1.69%	-0.12%
自基金合同 生效起至今	1.04%	0.81%	3.58%	1.03%	-2.54%	-0.22%

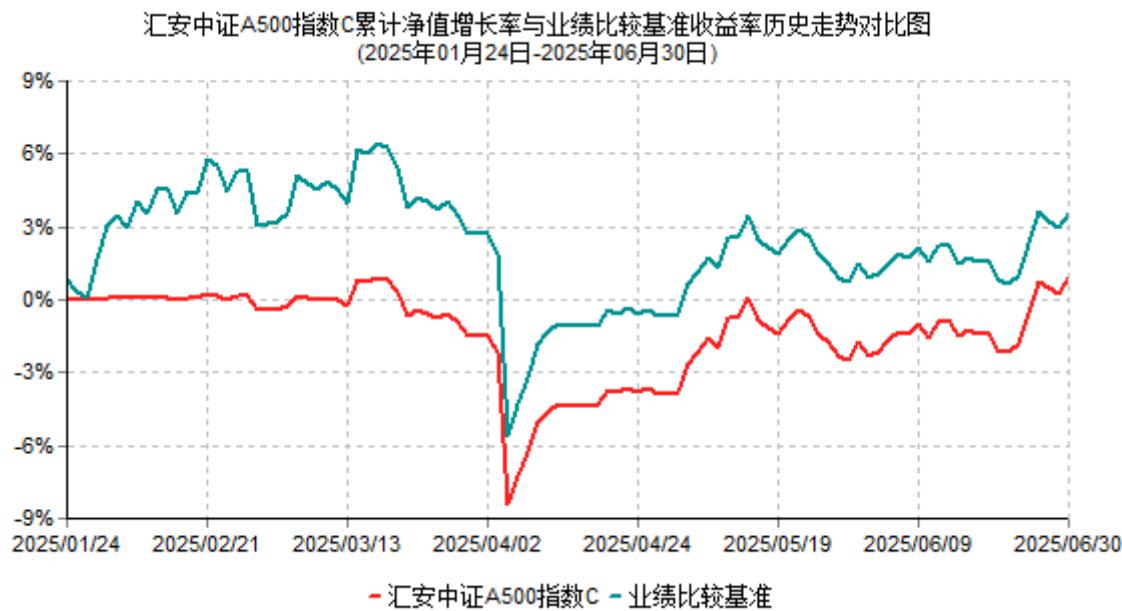
汇安中证A500指数C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率为标 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	3.31%	0.56%	2.68%	0.57%	0.63%	-0.01%
过去三个月	2.46%	1.02%	0.83%	1.14%	1.63%	-0.12%
自基金合同 生效起至今	0.93%	0.81%	3.58%	1.03%	-2.65%	-0.22%

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

汇安中证A500指数A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2025年01月24日-2025年06月30日)





注：①基金合同生效日为2025年1月24日，至本报告期末，本基金合同生效未满一年。

②根据《汇安中证A500指数证券投资基金基金合同》的规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股（含存托凭证，下同）、国内依法发行上市的股票（包含主板、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）、国内依法发行上市的债券（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债券、政府支持机构债券、政府支持债券等）、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、资产支持证券、国债期货、股指期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金根据相关法律法规可以参与融资及转融通证券出借业务。基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%且不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；股指期货、国债期货、股票期权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。根据基金合同的规定，自基金合同生效之日起6个月内基金各项资产配置比例需符合基金合同要求。本基金建仓期为2025年1月24日至2025年7月23日，截至本报告期末，本基金仍处于建仓期。

§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

本基金管理人为汇安基金管理有限责任公司，于2016年4月19日获中国证监会批复，2016年4月25日正式成立，是业内首家全自然人、由内部核心专业人士控股的公募基金管理公司，注册资本1亿元人民币，注册地为上海市，设北京、上海双总部。公司目前具有公开募集证券投资基金管理、基金销售、特定客户资产管理的资格。

截至2025年6月30日，公司旗下管理68只公募基金

汇安嘉源纯债债券型证券投资基金

汇安丰利灵活配置混合型证券投资基金

汇安丰泽灵活配置混合型证券投资基金

汇安沪深300指数增强型证券投资基金

汇安嘉裕纯债债券型证券投资基金

汇安多策略灵活配置混合型证券投资基金

汇安资产轮动灵活配置混合型证券投资基金

汇安裕华纯债定期开放债券型发起式证券投资基金

汇安成长优选灵活配置混合型证券投资基金

汇安稳裕债券型证券投资基金

汇安趋势动力股票型证券投资基金

汇安量化优选灵活配置混合型证券投资基金

汇安裕阳三年持有期混合型证券投资基金

汇安短债债券型证券投资基金

汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金

富时中国A50交易型开放式指数证券投资基金

汇安核心成长混合型证券投资基金

汇安鼎利纯债债券型证券投资基金

汇安多因子混合型证券投资基金

汇安行业龙头混合型证券投资基金

汇安中短债债券型证券投资基金

汇安嘉诚债券型证券投资基金

汇安量化先锋混合型证券投资基金

汇安中债-广西壮族自治区公司信用类债券指数证券投资基金

汇安宜创量化精选混合型证券投资基金

汇安嘉盛纯债债券型证券投资基金

汇安信利债券型证券投资基金

汇安裕和纯债债券型证券投资基金
汇安上证证券交易型开放式指数证券投资基金
汇安嘉利混合型证券投资基金
汇安核心资产混合型证券投资基金
汇安裕鑫12个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金
汇安价值蓝筹混合型证券投资基金
汇安消费龙头混合型证券投资基金
汇安恒鑫12个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金
汇安中证500指数增强型证券投资基金
汇安泓阳三年持有期混合型证券投资基金
汇安恒利39个月定期开放纯债债券型证券投资基金
汇安盛鑫三年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金
汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金
汇安均衡优选混合型证券投资基金
汇安核心价值混合型证券投资基金
汇安鑫利优选混合型证券投资基金
汇安泓利一年持有期混合型证券投资基金
汇安鑫泽稳健一年持有期混合型证券投资基金
汇安信泰稳健一年持有期混合型证券投资基金
汇安优势企业精选混合型证券投资基金
汇安永利30天持有期短债债券型证券投资基金
汇安润阳三年持有期混合型证券投资基金
汇安永福90天持有期中短债债券型证券投资基金
汇安裕同纯债债券型证券投资基金
汇安添利18个月持有期混合型证券投资基金
汇安远见成长混合型证券投资基金
汇安品质优选混合型证券投资基金
汇安价值先锋混合型证券投资基金
汇安裕盈纯债债券型证券投资基金
汇安裕泰纯债债券型证券投资基金
汇安中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金
汇安均衡成长混合型证券投资基金
汇安行业优选混合型证券投资基金
汇安中债0-3年政策性金融债指数证券投资基金
汇安景气成长混合型证券投资基金

汇安中证A500指数证券投资基金
 汇安裕宏利率债债券型证券投资基金
 汇安聚利债券型证券投资基金

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
陈思余	策略量化组基金经理、本基金的基金经理	2025-01-24	-	8年	陈思余先生，南开大学信息安全与法学双学位学士，8年证券、基金行业从业经验。历任天源迪科信息技术股份有限公司计费产品一部JAVA开发工程师。2017年4月加入汇安基金管理有限责任公司，担任策略量化组基金经理。2023年10月25日至2024年11月14日，任汇安量化先锋混合型证券投资基金基金经理；2023年10月25日至今，任汇安上证证券交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2023年10月25日至今，任富时中国A50交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2025年1月24日至今，任汇安中证A500指数证券投资基金基金经理。

上述任职日期、离职日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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

本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求利益，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

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，完善相应制度及流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，确保公平交易原则的实现。基金管理人公平对待旗下管理的所有投资组合，报告期内公平交易制度得到良好的贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的情况。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

基金管理人严格执行不同投资组合之间的同日反向交易，禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。报告期内，本基金未发现可能的异常交易情况，不存在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成交量超过该证券当日成交量的5%的情况。

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

2025年上半年，中国经济在“前高后稳”的节奏中完成动能转换：外需退坡、内需接棒，财政货币协同、产业与消费共振。

宏观经济运行特征：从“冲高”到“稳态”。增长动能：由“快”转“稳”。一季度经济冲高后，二季度增速温和回落至潜在水平附近。工业端冷热分化：装备制造业保持高景气，而建筑业则因专项债资金集中拨付，施工强度显著抬升。居民消费成为最亮眼的拉动力，其对整体增长的贡献比例已提升较大，较大程度上抵消了外需放缓的拖累。金融支持：量稳价降。上半年社会融资规模延续扩张，国债在新增融资中占比超过三分

之一，显示财政与货币协同发力。广义货币增速重新上行，企业融资成本继续下降，绿色贷款与科创再贷款规模快速膨胀，表明信贷结构正持续向“新质生产力”倾斜。

外部环境冲击：关税拉锯与供应链再平衡。关税博弈：高波幅、短周期。年初美方将部分半导体产品关税提高至历史极值，一度触发全球产能再布局；5月日内瓦临时协议后税率快速回落。中国同步打出“稀土牌”与“RCEP牌”，稳住了对欧出口，并在战略材料领域强化了议价能力。当前税率进入“90日暂停期”，但政策反复风险犹存，需要警惕新一轮供应链扰动。**贸易版图：**西方不亮东方亮。对美出口延续收缩，但对东盟和RCEP伙伴的出口增速接近两成，新能源车与半导体设备出口更是实现倍增，跨境电商成为外贸“第三极”。**金融韧性：**双向波动中的底气。人民币汇率保持区间双向波动，官方篮子货币权重继续上调。外资回流迹象明显，特别国债纳入国际指数后，被动资金稳步增配人民币资产。

政策落地效果：财政精准、货币灵活。财政端：超长期国债“长钱长用”。首批超长期特别国债顺利发行，专项债拨付进度快于往年同期，债务压力较大的省份已启动隐性债务置换，财政可持续性得到阶段性修复。货币端：利率曲线整体下移。贷款市场报价利率两次下调，带动企业融资成本降至近十年低位；存量房贷利率同步下调，数千万家庭月供负担明显减轻。

2025年上半年，中证A500指数先抑后扬，政策端持续发力为指数提供了流动性与信心双重支撑。产业政策向“高股息+科技创新”双主线倾斜，资金借道A500指数布局新质生产力龙头，推动指数在宽幅震荡中实现估值修复与结构升级。

本基金以被动投资策略为基础，致力于跟踪误差的最小化，紧密跟踪中证A500指数的表现，确保基金回报与指数保持高度一致。基金管理人将恪守职责，努力为投资者提供中国经济持续增长带来的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末汇安中证A500指数A基金份额净值为1.0104元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.04%，同期业绩比较基准收益率为3.58%；截至报告期末汇安中证A500指数C基金份额净值为1.0093元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.93%，同期业绩比较基准收益率为3.58%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025年下半年，宏观调控将围绕“稳增长、防风险、促转型”三条主线展开，力度更大、节奏更准、协同更深。

稳增长：存量更新与消费升级同步发力。7月政治局会议有望推出消费基础设施REITs试点，为沉淀的不动产注入流动性。同时，超大特大城市的城中村改造年度投资计划上调，通过“留改拆”并举，撬动数倍社会资本，形成“财政投一点、市场跟一串”

的乘数效应。防风险：地产与外部摩擦双线应对。政策有望将继续下调首付比例、扩大“白名单”融资，并允许专项债资金适度用于土储，防止风险向上下游蔓延。对外，美国拟把光伏组件纳入新一轮301调查，国内将加快技术迭代和海外产能布局，把关税压力转化为技术护城河。若美联储延后降息，央行已备好远期售汇风险准备金、扩围资金池等工具，保持人民币在合理区间双向波动。促转型：制度型开放与新质生产力并行。全国版跨境服务贸易负面清单再瘦身，自贸试验区联动创新区扩容，探索数据跨境“正面清单+安全评估”双轨管理。产业端，设备更新贴息、绿色再贷款、以旧换新补贴叠加发力，推动新质生产力再上台阶。

政策通过城中村改造、REITs、降准、PSL等组合拳稳住内需，以技术升级与市场多元对冲外部冲击，用制度型开放吸引全球资本与产业，继续巩固中国在全球供应链中的关键节点地位，为世界经济注入可持续的东方动能。

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《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，公司运营总监担任估值委员会主席，投资部门、合规风控部和运营部指定人员担任委员。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，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及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所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

本基金本报告期内未发生利润分配情况。

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，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在汇安中证A500指数证券投资基金（以下简称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《汇安中证A500指数证券投资基金2025年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

§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：汇安中证A500指数证券投资基金

报告截止日：2025年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025年06月30日
资产：		

货币资金	6.4.7.1	9,060,374.45
结算备付金		2,412.44
存出保证金		27,485.56
交易性金融资产	6.4.7.2	82,303,940.56
其中：股票投资		82,303,940.56
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		892,861.86
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		92,287,074.87
负债和净资产	附注号	本期末 2025年06月30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		-
应付赎回款		5,470,255.37
应付管理人报酬		38,284.81
应付托管费		7,656.97
应付销售服务费		18,193.11
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	99,028.02
负债合计		5,633,418.28
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	85,852,158.15
未分配利润	6.4.7.8	801,498.44
净资产合计		86,653,656.59
负债和净资产总计		92,287,074.87

注：1. 报告截止日2025年6月30日，基金份额总额85,852,158.15份，其中汇安中证A500指数A基金份额净值1.0104元，份额总额3,520,865.92份；汇安中证A500指数C基金份额净值1.0093元，份额总额82,331,292.23份。

2. 本财务报表的实际编制期间为2025年1月24日(基金合同生效日)至2025年6月30日止期间。

6.2 利润表

会计主体：汇安中证A500指数证券投资基金

本报告期：2025年01月24日（基金合同生效日）至2025年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025年01月24日(基金合同 生效日)至2025年06月30 日
一、营业收入		1,493,168.22
1.利息收入		200,682.44
其中：存款利息收入	6.4.7.9	137,069.87
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		63,612.57
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		902,195.50

其中：股票投资收益	6.4.7.10	-53,662.02
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	955,857.52
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	390,286.74
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	3.54
减：二、营业总支出		555,074.82
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	276,404.46
2.托管费	6.4.10.2.2	55,280.94
3.销售服务费	6.4.10.2.3	130,591.02
4.投资顾问费		-
5.利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.信用减值损失		-
7.税金及附加		-
8.其他费用	6.4.7.18	92,798.40
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		938,093.40
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		938,093.40
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		938,093.40

6.3 净资产变动表

会计主体：汇安中证A500指数证券投资基金

本报告期：2025年01月24日（基金合同生效日）至2025年06月30日

单位：人民币元

项目	本期		
	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	222,952,890.05	-	222,952,890.05
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-137,100,731.90	801,498.44	-136,299,233.46
(一)、综合收益总额	-	938,093.40	938,093.40
(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）	-137,100,731.90	-136,594.96	-137,237,326.86
其中：1.基金申购款	6,669,305.63	-31,798.73	6,637,506.90
2.基金赎回款	-143,770,037.53	-104,796.23	-143,874,833.76
(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	85,852,158.15	801,498.44	86,653,656.59

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：

刘强

王嘉浩

江士

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

汇安中证A500指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2024]1811号《关于准予汇安中证A500指数证券投资基金注册的批复》注册,由汇安基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇安中证A500指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币222,905,833.65元,业经容诚会计师事务所(特殊普通合伙)容诚验字[2025]200Z0019号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《汇安中证A500指数证券投资基金基金合同》于2025年1月24日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额222,952,890.05份基金份额,其中认购资金利息折合47,056.40份基金份额。本基金的基金管理人为汇安基金管理有限责任公司,基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《汇安中证A500指数证券投资基金基金合同》和《汇安中证A500指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金根据认购费/申购费及销售服务费收取方式的不同将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购基金时收取认购/申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额;在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费,并在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额,称为C类基金份额。本基金A类和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间的转换规定请见相关公告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇安中证A500指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括标的指数成份股及其备选成份股(含存托凭证,下同)、国内依法发行上市的股票(包含主板、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)、国内依法发行上市的债券(包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、可交换债券、政府支持机构债券、政府支持债券等)、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、资产支持证券、国债期货、股指期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金根据相关法律法规可以参与融资及转融通证券出借业务。本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%且不低

于非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；股指期货、国债期货、股票期权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。本基金的业绩比较基准为：中证A500指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人汇安基金管理有限责任公司于2025年8月28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》、《汇安中证A500指数证券投资基金基金合同》和中国证监会、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2025年6月30日的财务状况以及2025年1月24日（基金合同生效日）至2025年6月30日的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

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

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

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

(2) 金融负债

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

(3) 衍生金融工具

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

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易

价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

6.4.4.8 损益平准金

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

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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

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

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号

《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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。

对证券投资基金经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 2025年06月30日
活期存款	9,060,374.45
等于： 本金	9,059,766.27
加： 应计利息	608.18
减： 坏账准备	-
定期存款	-
等于： 本金	-
加： 应计利息	-
减： 坏账准备	-
其中： 存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于： 本金	-

加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	9,060,374.45

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	81,913,653.82	-	82,303,940.56	390,286.74
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	81,913,653.82	-	82,303,940.56	390,286.74

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

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

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025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	6,629.62
其中：交易所市场	6,629.62
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	23,099.60
预提费用-信息披露费	69,298.80
合计	99,028.02

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 汇安中证A500指数A

金额单位：人民币元

项目 (汇安中证A500指数A)	本期 2025年01月24日（基金合同生效日）至2025年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	12,048,516.92	12,048,516.92
本期申购	225,565.19	225,565.19
本期赎回（以“-”号填列）	-8,753,216.19	-8,753,216.19
本期末	3,520,865.92	3,520,865.92

6.4.7.7.2 汇安中证A500指数C

金额单位：人民币元

项目 (汇安中证A500指数C)	本期 2025年01月24日（基金合同生效日）至2025年06月30日

	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	210,904,373.13	210,904,373.13
本期申购	6,443,740.44	6,443,740.44
本期赎回(以“-”号填列)	-135,016,821.34	-135,016,821.34
本期末	82,331,292.23	82,331,292.23

注：1. 申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 本基金自2024年12月24日至2025年1月21日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币222,905,833.65元，折合为222,905,833.65份基金份额(其中A类基金份额12,045,372.58份，C类基金份额210,860,461.07份)。根据《汇安中证A500指数证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币47,056.40元在本基金成立后，折合为47,056.40份基金份额(其中A类基金份额3,144.34份，C类基金份额43,912.06份)，划入基金份额持有人账户。

3. 根据《汇安中证A500指数证券投资基金基金合同》、《汇安中证A500指数证券投资基金招募说明书》及《汇安中证A500指数证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告》的相关规定，本基金于2025年1月24日(基金合同生效日)至2025年2月23日止期间暂不向投资人开放基金交易，申购业务、赎回业务和转换业务自2025年2月24日起开始办理。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 汇安中证A500指数A

单位：人民币元

项目 (汇安中证A500指数A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	31,651.68	66,817.41	98,469.09
本期基金份额交易产 生的变动数	-6,032.22	-55,894.31	-61,926.53
其中：基金申购款	43.80	-3,654.94	-3,611.14
基金赎回款	-6,076.02	-52,239.37	-58,315.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	25,619.46	10,923.10	36,542.56

6.4.7.8.2 汇安中证A500指数C

单位：人民币元

项目 (汇安中证A500指数C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	516,154.98	323,469.33	839,624.31
本期基金份额交易产 生的变动数	-5,112.23	-69,556.20	-74,668.43
其中：基金申购款	-2,271.07	-25,916.52	-28,187.59
基金赎回款	-2,841.16	-43,639.68	-46,480.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	511,042.75	253,913.13	764,955.88

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月24日（基金合同生效日）至2025年06月30 日
活期存款利息收入	116,430.83
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	20,613.58
其他	25.46
合计	137,069.87

6.4.7.10 股票投资收益**6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月24日（基金合同生效日）至2025年06月30 日

卖出股票成交总额	14,848,189.29
减： 卖出股票成本总额	14,866,517.79
减： 交易费用	35,333.52
买卖股票差价收入	-53,662.02

6.4.7.10.2 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.11 债券投资收益**6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

无。

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益**6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成**

无。

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13 贵金属投资收益

6.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14 衍生工具收益**6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月24日（基金合同生效日）至2025年06月30日
股票投资产生的股利收益	955,857.52
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	955,857.52

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年01月24日（基金合同生效日）至2025年06月30日
1.交易性金融资产	390,286.74

——股票投资	390,286.74
——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	390,286.74

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月24日（基金合同生效日）至2025年06月30 日
基金赎回费收入	3.54
合计	3.54

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月24日（基金合同生效日）至2025年06月30 日
审计费用	23,099.60
信息披露费	69,298.80
证券出借违约金	-
开户费	400.00

合计	92,798.40
----	-----------

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

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

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
汇安基金管理有限责任公司	基金管理人、基金登记机构、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
何斌	基金管理人的股东
秦军	基金管理人的股东
郭小峰	基金管理人的股东
任建辉	基金管理人的股东
刘强	基金管理人的股东
郭兆强	基金管理人的股东
尹喜杰	基金管理人的股东
王福德	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

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 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	276,404.46
其中：应支付销售机构的客户维护费	138,167.42
应支付基金管理人的净管理费	138,237.04

注：支付基金管理人汇安基金管理有限责任公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.50%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	55,280.94

注：支付基金托管人光大银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2025年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销售服务费		
	汇安中证A500指数A	汇安中证A500指数C	合计
中国光大银行股份有限公司	0.00	130,391.99	130,391.99
合计	0.00	130,391.99	130,391.99

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给汇安基金管理有限责任公司，再由汇安基金管理有限责任公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费=前一日C类基金份额的基金资产净值×0.25% / 当年天数。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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 2025年01月24日（基金合同生效日）至2025年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国光大银行股份有限公司	9,060,374.45	116,430.83

注：本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行股份有限公司保管，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

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

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

无。

6.4.12 期末（2025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

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

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

本基金为股票型基金，其风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。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。

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过管理及信息系统持续监控上述各类风险。

公司建立董事会领导下的风险管理体系，包括董事会的下设的风险控制委员会、总经理下设的风险管理委员会、督察长、合规风控部以及各个业务部门组成。

公司致力于实行全面、系统的风险管理，通过制定系统化的风险管理程序，对风险管理的整个流程进行评估和改进。公司奉行分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，构建由四大防线共同筑成的风险管理体系：第一道防线由各个业务部门构成，各业务部门总监作为风险责任人；第二道监控防线由合规风控部构成，对公司运营过程中产生的或潜在的各项风险进行有效管理，并就内部控制及风险管理制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能；第三道防线是由总经理及其下设的风险管理委员会构成，总经理负责公司日常经营管理中的风险管理工作。总经理下设风险管理委员会，负责对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和防控；第四道监控防线由董事会及其下设公司风险控制委员会构成。董事会负责公司整体风险的预防和控制，审核、监督公司管理制度的有效执行。董事会下设公司风险控制委员会，协助董事会确立公司风险取向，风险总量、风险限额，制定和调整公司风险管理战略、原则、政策和指导方针，并确保其得到有效执行。

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，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中国光大银行股份有限公司，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。

于2025年06月30日，本基金无债券投资或资产支持证券投资。

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。

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，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模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于2025年06月30日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

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管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30% (完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，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附注6.4.12。本基金主动投资于流动性

受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2025年06月30日，本基金无流动性受限资产。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于2025年06月30日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025年	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

06月30 日					
资产					
货币资 金	9,060,374.45	-	-	-	9,060,374.45
结算备 付金	2,412.44	-	-	-	2,412.44
存出保 证金	27,485.56	-	-	-	27,485.56
交易性 金融资 产	-	-	-	82,303,940.56	82,303,940.56
应收清 算款	-	-	-	892,861.86	892,861.86
资产总 计	9,090,272.45	-	-	83,196,802.42	92,287,074.87
负债					
应付赎 回款	-	-	-	5,470,255.37	5,470,255.37
应付管 理人报 酬	-	-	-	38,284.81	38,284.81
应付托 管费	-	-	-	7,656.97	7,656.97
应付销 售服务 费	-	-	-	18,193.11	18,193.11
其他负 债	-	-	-	99,028.02	99,028.02
负债总 计	-	-	-	5,633,418.28	5,633,418.28
利率敏	9,090,272.45	-	-	77,563,384.14	86,653,656.59

感度缺口					
------	--	--	--	--	--

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

于2025年06月30日，本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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。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。

本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数成分股组成及其权重构建投资组合，并根据标的指数成分股及其权重的变动进行相应调整。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中投资于标的指数成分股和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，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 2025年06月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	82,303,940.56	94.98
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	82,303,940.56	94.98

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2025年6月30日，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

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 2025年06月30日
第一层次	82,303,940.56
第二层次	-
第三层次	-
合计	82,303,940.56

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2025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。

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

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	82,303,940.56	89.18
	其中：股票	82,303,940.56	89.18
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	9,062,786.89	9.82
8	其他各项资产	920,347.42	1.00
9	合计	92,287,074.87	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	451,098.00	0.52
B	采矿业	4,147,550.50	4.79
C	制造业	47,794,355.02	55.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,524,998.00	2.91
E	建筑业	1,572,003.00	1.81
F	批发和零售业	607,081.00	0.70
G	交通运输、仓储和邮政业	2,891,317.00	3.34
H	住宿和餐饮业	75,717.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,471,553.04	6.31
J	金融业	13,210,006.00	15.24
K	房地产业	882,602.00	1.02
L	租赁和商务服务业	918,890.00	1.06
M	科学研究和技术服务业	916,287.00	1.06
N	水利、环境和公共设施管理业	197,669.00	0.23
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	59,364.00	0.07
Q	卫生和社会工作	311,392.00	0.36
R	文化、体育和娱乐业	272,058.00	0.31
S	综合	-	-
	合计	82,303,940.56	94.98

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积极投资的股票。

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	600519	贵州茅台	2,200	3,100,944.00	3.58
2	300750	宁德时代	9,400	2,370,868.00	2.74
3	601318	中国平安	38,100	2,113,788.00	2.44
4	600036	招商银行	43,900	2,017,205.00	2.33
5	601166	兴业银行	58,900	1,374,726.00	1.59
6	600900	长江电力	43,400	1,308,076.00	1.51
7	000333	美的集团	17,400	1,256,280.00	1.45
8	601899	紫金矿业	58,400	1,138,800.00	1.31
9	002594	比亚迪	3,200	1,062,112.00	1.23
10	300059	东方财富	44,800	1,036,224.00	1.20
11	600030	中信证券	34,600	955,652.00	1.10
12	601398	工商银行	124,200	942,678.00	1.09
13	000858	五粮液	6,900	820,410.00	0.95
14	600276	恒瑞医药	15,800	820,020.00	0.95
15	601328	交通银行	94,600	756,800.00	0.87
16	000651	格力电器	15,900	714,228.00	0.82
17	601288	农业银行	113,200	665,616.00	0.77
18	688981	中芯国际	7,131	628,740.27	0.73
19	600887	伊利股份	22,400	624,512.00	0.72

20	002475	立讯精密	18,000	624,420.00	0.72
21	600919	江苏银行	52,000	620,880.00	0.72
22	603259	药明康德	8,900	618,995.00	0.71
23	601816	京沪高铁	104,000	598,000.00	0.69
24	600000	浦发银行	41,600	577,408.00	0.67
25	000725	京东方 A	130,200	519,498.00	0.60
26	002371	北方华创	1,100	486,431.00	0.56
27	688256	寒武纪	800	481,200.00	0.56
28	601088	中国神华	11,800	478,372.00	0.55
29	300760	迈瑞医疗	2,100	471,975.00	0.54
30	300308	中际旭创	3,200	466,752.00	0.54
31	688041	海光信息	3,262	460,887.98	0.53
32	601601	中国太保	12,100	453,871.00	0.52
33	300502	新易盛	3,560	452,191.20	0.52
34	300124	汇川技术	6,700	432,619.00	0.50
35	601728	中国电信	55,700	431,675.00	0.50
36	601668	中国建筑	74,100	427,557.00	0.49
37	000001	平安银行	34,800	420,036.00	0.48
38	002352	顺丰控股	8,600	419,336.00	0.48
39	002714	牧原股份	9,800	411,698.00	0.48
40	002230	科大讯飞	8,300	397,404.00	0.46
41	601127	赛力斯	2,900	389,528.00	0.45
42	603501	豪威集团	3,000	382,950.00	0.44
43	600031	三一重工	21,300	382,335.00	0.44
44	000063	中兴通讯	11,600	376,884.00	0.43
45	603019	中科曙光	5,200	366,080.00	0.42
46	002415	海康威视	13,200	366,036.00	0.42
47	600309	万华化学	6,700	363,542.00	0.42
48	600941	中国移动	3,200	360,160.00	0.42
49	300274	阳光电源	5,200	352,404.00	0.41
50	601857	中国石油	40,700	347,985.00	0.40

51	601919	中远海控	22,600	339,904.00	0.39
52	688008	澜起科技	4,083	334,806.00	0.39
53	600690	海尔智家	13,500	334,530.00	0.39
54	601012	隆基绿能	21,700	325,934.00	0.38
55	600660	福耀玻璃	5,700	324,957.00	0.38
56	600406	国电南瑞	14,400	322,704.00	0.37
57	601766	中国中车	43,600	306,944.00	0.35
58	603986	兆易创新	2,400	303,672.00	0.35
59	600050	中国联通	56,100	299,574.00	0.35
60	000338	潍柴动力	19,400	298,372.00	0.34
61	600028	中国石化	52,300	294,972.00	0.34
62	000568	泸州老窖	2,600	294,840.00	0.34
63	000100	TCL科技	67,400	291,842.00	0.34
64	688012	中微公司	1,600	291,680.00	0.34
65	601988	中国银行	51,300	288,306.00	0.33
66	601006	大秦铁路	43,400	286,440.00	0.33
67	300476	胜宏科技	2,100	282,198.00	0.33
68	601985	中国核电	29,500	274,940.00	0.32
69	601225	陕西煤业	13,900	267,436.00	0.31
70	600104	上汽集团	16,600	266,430.00	0.31
71	002027	分众传媒	36,300	264,990.00	0.31
72	600150	中国船舶	8,000	260,320.00	0.30
73	600418	江淮汽车	6,300	252,567.00	0.29
74	601628	中国人寿	6,000	247,140.00	0.29
75	600760	中航沈飞	4,000	234,480.00	0.27
76	603288	海天味业	6,000	233,460.00	0.27
77	000425	徐工机械	29,500	229,215.00	0.26
78	000792	盐湖股份	13,300	227,164.00	0.26
79	000625	长安汽车	17,800	227,128.00	0.26
80	600111	北方稀土	9,100	226,590.00	0.26
81	600938	中国海油	8,600	224,546.00	0.26

82	688111	金山办公	800	224,040.00	0.26
83	600436	片仔癀	1,100	220,011.00	0.25
84	605499	东鹏饮料	700	219,835.00	0.25
85	688271	联影医疗	1,718	219,457.32	0.25
86	600905	三峡能源	51,300	218,538.00	0.25
87	300033	同花顺	800	218,408.00	0.25
88	601658	邮储银行	39,500	216,065.00	0.25
89	600089	特变电工	18,100	215,933.00	0.25
90	002625	光启技术	5,400	215,892.00	0.25
91	601888	中国中免	3,500	213,395.00	0.25
92	603993	洛阳钼业	25,200	212,184.00	0.24
93	002050	三花智控	8,000	211,040.00	0.24
94	600048	保利发展	25,800	208,980.00	0.24
95	300015	爱尔眼科	16,700	208,416.00	0.24
96	600547	山东黄金	6,500	207,545.00	0.24
97	600019	宝钢股份	31,400	206,926.00	0.24
98	601390	中国中铁	36,800	206,448.00	0.24
99	002241	歌尔股份	8,800	205,216.00	0.24
100	002463	沪电股份	4,800	204,384.00	0.24
101	600415	小商品城	9,800	202,664.00	0.23
102	300014	亿纬锂能	4,400	201,564.00	0.23
103	601600	中国铝业	28,400	199,936.00	0.23
104	601989	中国重工	40,900	189,776.00	0.22
105	000977	浪潮信息	3,700	188,256.00	0.22
106	002179	中航光电	4,600	185,656.00	0.21
107	002384	东山精密	4,900	185,073.00	0.21
108	600893	航发动力	4,800	184,992.00	0.21
109	600585	海螺水泥	8,600	184,642.00	0.21
110	603799	华友钴业	4,900	181,398.00	0.21
111	600570	恒生电子	5,400	181,116.00	0.21
112	000538	云南白药	3,200	178,528.00	0.21

113	000938	紫光股份	7,200	172,728.00	0.20
114	600584	长电科技	5,100	171,819.00	0.20
115	000988	华工科技	3,600	169,236.00	0.20
116	601727	上海电气	22,700	167,753.00	0.19
117	600438	通威股份	9,700	162,475.00	0.19
118	002028	思源电气	2,200	160,402.00	0.19
119	300408	三环集团	4,800	160,320.00	0.19
120	300433	蓝思科技	7,100	158,330.00	0.18
121	002049	紫光国微	2,400	158,064.00	0.18
122	000002	万科 A	24,400	156,648.00	0.18
123	600795	国电电力	32,000	154,880.00	0.18
124	600489	中金黄金	10,400	152,152.00	0.18
125	601669	中国电建	30,900	150,483.00	0.17
126	600988	赤峰黄金	6,000	149,280.00	0.17
127	300339	润和软件	2,900	147,407.00	0.17
128	601689	拓普集团	3,100	146,475.00	0.17
129	600010	包钢股份	81,200	145,348.00	0.17
130	002422	科伦药业	4,000	143,680.00	0.17
131	600009	上海机场	4,500	142,965.00	0.16
132	002456	欧菲光	11,900	141,015.00	0.16
133	600160	巨化股份	4,800	137,664.00	0.16
134	601100	恒立液压	1,900	136,800.00	0.16
135	000768	中航西飞	5,000	136,700.00	0.16
136	002460	赣锋锂业	4,000	135,080.00	0.16
137	600183	生益科技	4,400	132,660.00	0.15
138	300394	天孚通信	1,660	132,534.40	0.15
139	601186	中国铁建	16,500	132,165.00	0.15
140	002252	上海莱士	19,000	130,530.00	0.15
141	000157	中联重科	17,800	128,694.00	0.15
142	601360	三六零	12,600	128,520.00	0.15
143	600839	四川长虹	13,200	128,304.00	0.15

144	600989	宝丰能源	7,900	127,506.00	0.15
145	688036	传音控股	1,591	126,802.70	0.15
146	600886	国投电力	8,600	126,764.00	0.15
147	002074	国轩高科	3,900	126,594.00	0.15
148	000963	华东医药	3,100	125,116.00	0.14
149	300442	润泽科技	2,500	123,825.00	0.14
150	600115	中国东航	30,700	123,721.00	0.14
151	601058	赛轮轮胎	9,300	122,016.00	0.14
152	000408	藏格矿业	2,800	119,476.00	0.14
153	000661	长春高新	1,200	119,016.00	0.14
154	002466	天齐锂业	3,700	118,548.00	0.14
155	000807	云铝股份	7,400	118,252.00	0.14
156	002517	恺英网络	6,100	117,791.00	0.14
157	002001	新和成	5,500	116,985.00	0.14
158	600066	宇通客车	4,700	116,842.00	0.13
159	002340	格林美	18,400	116,840.00	0.13
160	300661	圣邦股份	1,590	115,704.30	0.13
161	600426	华鲁恒升	5,300	114,851.00	0.13
162	301236	软通动力	2,100	114,744.00	0.13
163	600029	南方航空	19,300	113,870.00	0.13
164	000975	山金国际	6,000	113,640.00	0.13
165	002195	岩山科技	20,100	113,163.00	0.13
166	002558	巨人网络	4,800	113,040.00	0.13
167	600196	复星医药	4,500	112,905.00	0.13
168	600011	华能国际	15,800	112,812.00	0.13
169	002156	通富微电	4,400	112,728.00	0.13
170	600346	恒力石化	7,900	112,654.00	0.13
171	600674	川投能源	7,000	112,280.00	0.13
172	001979	招商蛇口	12,800	112,256.00	0.13
173	601800	中国交建	12,600	112,014.00	0.13
174	002236	大华股份	7,000	111,160.00	0.13

175	688126	沪硅产业	5,912	110,672.64	0.13
176	002648	卫星化学	6,300	109,179.00	0.13
177	600487	亨通光电	7,100	108,630.00	0.13
178	300418	昆仑万维	3,200	107,616.00	0.12
179	300251	光线传媒	5,300	107,431.00	0.12
180	300207	欣旺达	5,300	106,318.00	0.12
181	601111	中国国航	13,300	104,937.00	0.12
182	601319	中国人保	12,000	104,520.00	0.12
183	600745	闻泰科技	3,100	103,943.00	0.12
184	600372	中航机载	8,600	103,716.00	0.12
185	601868	中国能建	46,500	103,695.00	0.12
186	600879	航天电子	9,900	103,653.00	0.12
187	600588	用友网络	7,700	102,949.00	0.12
188	600256	广汇能源	17,100	102,942.00	0.12
189	600176	中国巨石	9,000	102,600.00	0.12
190	002920	德赛西威	1,000	102,130.00	0.12
191	000066	中国长城	6,900	102,120.00	0.12
192	688777	中控技术	2,268	101,855.88	0.12
193	600460	士兰微	4,100	101,762.00	0.12
194	003816	中国广核	27,900	101,556.00	0.12
195	002916	深南电路	940	101,341.40	0.12
196	300347	泰格医药	1,900	101,308.00	0.12
197	688120	华海清科	600	101,220.00	0.12
198	601633	长城汽车	4,700	100,956.00	0.12
199	600741	华域汽车	5,700	100,605.00	0.12
200	600219	南山铝业	26,200	100,346.00	0.12
201	688169	石头科技	640	100,192.00	0.12
202	601021	春秋航空	1,800	100,170.00	0.12
203	300782	卓胜微	1,400	99,918.00	0.12
204	002273	水晶光电	5,000	99,850.00	0.12
205	601168	西部矿业	6,000	99,780.00	0.12

206	601117	中国化学	13,000	99,710.00	0.12
207	600352	浙江龙盛	9,800	99,568.00	0.11
208	002465	海格通信	7,100	98,974.00	0.11
209	600096	云天化	4,500	98,865.00	0.11
210	688608	恒玄科技	283	98,478.34	0.11
211	000933	神火股份	5,900	98,176.00	0.11
212	000831	中国稀土	2,700	97,524.00	0.11
213	002601	龙佰集团	6,000	97,260.00	0.11
214	600039	四川路桥	9,800	97,020.00	0.11
215	002185	华天科技	9,600	96,960.00	0.11
216	300450	先导智能	3,900	96,915.00	0.11
217	600482	中国动力	4,200	96,894.00	0.11
218	002555	三七互娱	5,600	96,824.00	0.11
219	302132	中航成飞	1,100	96,734.00	0.11
220	000630	铜陵有色	28,900	96,526.00	0.11
221	000786	北新建材	3,600	95,328.00	0.11
222	002294	信立泰	2,000	94,660.00	0.11
223	300017	网宿科技	8,800	94,336.00	0.11
224	600885	宏发股份	4,220	94,148.20	0.11
225	688235	百济神州	400	93,456.00	0.11
226	688506	百利天恒	315	93,277.80	0.11
227	001965	招商公路	7,700	92,400.00	0.11
228	688213	思特威	898	91,793.56	0.11
229	300866	安克创新	800	90,880.00	0.10
230	002493	荣盛石化	10,900	90,252.00	0.10
231	600085	同仁堂	2,500	90,150.00	0.10
232	002129	TCL中环	11,600	89,088.00	0.10
233	601877	正泰电器	3,900	88,413.00	0.10
234	688396	华润微	1,872	88,283.52	0.10
235	300896	爱美客	500	87,405.00	0.10
236	002709	天赐材料	4,800	86,976.00	0.10

237	600362	江西铜业	3,700	86,691.00	0.10
238	603129	春风动力	400	86,600.00	0.10
239	600161	天坛生物	4,500	86,355.00	0.10
240	688617	惠泰医疗	290	86,130.00	0.10
241	002130	沃尔核材	3,600	85,752.00	0.10
242	603392	万泰生物	1,400	85,400.00	0.10
243	688099	晶晨股份	1,200	85,212.00	0.10
244	002131	利欧股份	24,300	85,050.00	0.10
245	300454	深信服	900	84,762.00	0.10
246	300122	智飞生物	4,300	84,237.00	0.10
247	002085	万丰奥威	5,300	84,217.00	0.10
248	002281	光迅科技	1,700	83,844.00	0.10
249	002472	双环传动	2,500	83,725.00	0.10
250	000423	东阿阿胶	1,600	83,680.00	0.10
251	688002	睿创微纳	1,200	83,664.00	0.10
252	002738	中矿资源	2,600	83,616.00	0.10
253	688122	西部超导	1,608	83,423.04	0.10
254	300058	蓝色光标	12,700	83,312.00	0.10
255	002532	天山铝业	10,000	83,100.00	0.10
256	300223	北京君正	1,200	83,040.00	0.10
257	002595	豪迈科技	1,400	82,908.00	0.10
258	300002	神州泰岳	7,000	82,600.00	0.10
259	002180	纳思达	3,600	82,584.00	0.10
260	688578	艾力斯	883	82,154.32	0.09
261	300395	菲利华	1,600	81,760.00	0.09
262	002138	顺络电子	2,900	81,548.00	0.09
263	002436	兴森科技	6,100	80,764.00	0.09
264	002078	太阳纸业	6,000	80,760.00	0.09
265	300474	景嘉微	1,100	80,300.00	0.09
266	300496	中科创达	1,400	80,108.00	0.09
267	002938	鹏鼎控股	2,500	80,075.00	0.09

268	688047	龙芯中科	600	80,034.00	0.09
269	600233	圆通速递	6,200	79,918.00	0.09
270	300832	新产业	1,400	79,408.00	0.09
271	000999	华润三九	2,530	79,138.40	0.09
272	000301	东方盛虹	9,500	79,135.00	0.09
273	002128	电投能源	4,000	79,120.00	0.09
274	002410	广联达	5,900	79,119.00	0.09
275	000034	神州数码	2,100	79,044.00	0.09
276	603596	伯特利	1,500	79,035.00	0.09
277	300136	信维通信	3,500	78,400.00	0.09
278	600143	金发科技	7,600	78,356.00	0.09
279	002223	鱼跃医疗	2,200	78,320.00	0.09
280	600862	中航高科	3,000	78,240.00	0.09
281	688266	泽璟制药	727	78,159.77	0.09
282	688223	晶科能源	15,045	78,083.55	0.09
283	600845	宝信软件	3,300	77,946.00	0.09
284	600188	兖矿能源	6,400	77,888.00	0.09
285	300346	南大光电	2,460	77,834.40	0.09
286	002405	四维图新	9,100	77,714.00	0.09
287	603606	东方电缆	1,500	77,565.00	0.09
288	300054	鼎龙股份	2,700	77,436.00	0.09
289	300024	机器人	4,500	77,310.00	0.09
290	002271	东方雨虹	7,200	77,256.00	0.09
291	002353	杰瑞股份	2,200	77,000.00	0.09
292	002065	东华软件	8,000	76,800.00	0.09
293	601618	中国中冶	25,600	76,288.00	0.09
294	300759	康龙化成	3,100	76,074.00	0.09
295	600549	厦门钨业	3,600	75,312.00	0.09
296	002202	金风科技	7,300	74,825.00	0.09
297	601615	明阳智能	6,500	74,685.00	0.09
298	600895	张江高科	2,900	74,530.00	0.09

299	603605	珀莱雅	900	74,511.00	0.09
300	300383	光环新网	5,200	74,360.00	0.09
301	002624	完美世界	4,900	74,333.00	0.09
302	300627	华测导航	2,100	73,500.00	0.08
303	002008	大族激光	3,000	73,110.00	0.08
304	601872	招商轮船	11,600	72,616.00	0.08
305	300604	长川科技	1,600	71,856.00	0.08
306	600515	海南机场	20,200	71,508.00	0.08
307	603659	璞泰来	3,800	71,364.00	0.08
308	603087	甘李药业	1,300	71,214.00	0.08
309	600392	盛和资源	5,400	71,118.00	0.08
310	000426	兴业银锡	4,500	71,100.00	0.08
311	002459	晶澳科技	7,100	70,858.00	0.08
312	300037	新宙邦	2,000	70,400.00	0.08
313	300003	乐普医疗	5,100	70,278.00	0.08
314	300012	华测检测	6,000	70,140.00	0.08
315	000733	振华科技	1,400	70,070.00	0.08
316	300459	汤姆猫	12,500	70,000.00	0.08
317	600153	建发股份	6,700	69,479.00	0.08
318	002155	湖南黄金	3,890	69,436.50	0.08
319	605117	德业股份	1,300	68,458.00	0.08
320	600803	新奥股份	3,600	68,040.00	0.08
321	300316	晶盛机电	2,500	67,875.00	0.08
322	000878	云南铜业	5,300	67,416.00	0.08
323	688599	天合光能	4,635	67,346.55	0.08
324	601216	君正集团	12,100	66,792.00	0.08
325	300253	卫宁健康	6,300	66,780.00	0.08
326	605589	圣泉集团	2,400	66,600.00	0.08
327	300699	光威复材	2,100	66,507.00	0.08
328	000617	中油资本	9,100	66,430.00	0.08
329	600699	均胜电子	3,800	66,272.00	0.08

330	600332	白云山	2,500	65,900.00	0.08
331	300073	当升科技	1,500	65,805.00	0.08
332	600118	中国卫星	2,300	65,711.00	0.08
333	000519	中兵红箭	3,000	65,670.00	0.08
334	000932	华菱钢铁	14,900	65,560.00	0.08
335	600521	华海药业	3,500	65,205.00	0.08
336	688180	君实生物	1,909	64,867.82	0.07
337	000738	航发控制	3,100	64,325.00	0.07
338	002389	航天彩虹	2,500	64,000.00	0.07
339	002444	巨星科技	2,500	63,775.00	0.07
340	601233	桐昆股份	6,000	63,600.00	0.07
341	002152	广电运通	4,700	63,168.00	0.07
342	300142	沃森生物	5,700	62,700.00	0.07
343	300628	亿联网络	1,800	62,568.00	0.07
344	002414	高德红外	6,100	62,525.00	0.07
345	601799	星宇股份	500	62,500.00	0.07
346	600497	驰宏锌锗	11,800	62,422.00	0.07
347	300001	特锐德	2,600	62,322.00	0.07
348	000009	中国宝安	7,000	62,160.00	0.07
349	600038	中直股份	1,600	62,096.00	0.07
350	002821	凯莱英	700	61,775.00	0.07
351	600018	上港集团	10,800	61,668.00	0.07
352	603260	合盛硅业	1,300	61,620.00	0.07
353	002812	恩捷股份	2,100	61,509.00	0.07
354	688072	拓荆科技	400	61,484.00	0.07
355	002007	华兰生物	3,900	61,113.00	0.07
356	000400	许继电气	2,800	60,956.00	0.07
357	300568	星源材质	4,800	60,864.00	0.07
358	600765	中航重机	3,600	60,768.00	0.07
359	603979	金诚信	1,300	60,372.00	0.07
360	002409	雅克科技	1,100	60,159.00	0.07

361	300757	罗博特科	400	59,988.00	0.07
362	600177	雅戈尔	8,200	59,860.00	0.07
363	600398	海澜之家	8,600	59,856.00	0.07
364	601677	明泰铝业	4,800	59,616.00	0.07
365	600141	兴发集团	2,900	59,537.00	0.07
366	300315	掌趣科技	9,800	59,486.00	0.07
367	002607	中公教育	19,400	59,364.00	0.07
368	300919	中伟股份	1,800	59,184.00	0.07
369	601238	广汽集团	7,900	59,171.00	0.07
370	600704	物产中大	11,200	59,024.00	0.07
371	300413	芒果超媒	2,700	58,914.00	0.07
372	603939	益丰药房	2,400	58,728.00	0.07
373	600637	东方明珠	7,800	58,266.00	0.07
374	300088	长信科技	9,700	57,812.00	0.07
375	002245	蔚蓝锂芯	4,500	57,735.00	0.07
376	000623	吉林敖东	3,400	57,630.00	0.07
377	002044	美年健康	11,200	57,568.00	0.07
378	600529	山东药玻	2,600	57,564.00	0.07
379	601607	上海医药	3,200	57,216.00	0.07
380	600498	烽火通信	2,700	56,781.00	0.07
381	300182	捷成股份	10,300	56,753.00	0.07
382	600316	洪都航空	1,500	56,550.00	0.07
383	002318	久立特材	2,400	56,136.00	0.06
384	601567	三星医疗	2,500	56,050.00	0.06
385	300068	南都电源	3,500	55,720.00	0.06
386	601018	宁波港	15,000	54,900.00	0.06
387	002739	万达电影	4,800	54,864.00	0.06
388	600563	法拉电子	500	54,545.00	0.06
389	300724	捷佳伟创	1,000	54,300.00	0.06
390	000960	锡业股份	3,500	53,550.00	0.06
391	300144	宋城演艺	6,200	53,010.00	0.06

392	002407	多氟多	4,300	52,417.00	0.06
393	603486	科沃斯	900	52,407.00	0.06
394	688009	中国通号	10,167	52,258.38	0.06
395	600486	扬农化工	900	52,200.00	0.06
396	300558	贝达药业	900	52,155.00	0.06
397	002841	视源股份	1,500	51,900.00	0.06
398	000039	中集集团	6,600	51,876.00	0.06
399	002312	川发龙蟒	4,500	51,660.00	0.06
400	300763	锦浪科技	900	51,651.00	0.06
401	600026	中远海能	5,000	51,650.00	0.06
402	603568	伟明环保	2,700	51,516.00	0.06
403	002025	航天电器	1,000	51,410.00	0.06
404	002497	雅化集团	4,500	51,300.00	0.06
405	300296	利亚德	8,400	51,240.00	0.06
406	600998	九州通	9,900	50,886.00	0.06
407	600166	福田汽车	18,600	50,406.00	0.06
408	301358	湖南裕能	1,600	49,904.00	0.06
409	300676	华大基因	1,000	49,770.00	0.06
410	601179	中国西电	8,100	49,734.00	0.06
411	600208	衢州发展	16,700	49,432.00	0.06
412	000887	中鼎股份	2,800	49,252.00	0.06
413	601155	新城控股	3,600	49,248.00	0.06
413	600312	平高电气	3,200	49,248.00	0.06
415	688303	大全能源	2,308	49,206.56	0.06
416	605358	立昂微	2,100	48,930.00	0.06
417	300285	国瓷材料	2,800	48,580.00	0.06
418	000683	博源化工	10,100	48,379.00	0.06
419	601000	唐山港	11,900	48,314.00	0.06
420	600820	隧道股份	7,900	48,190.00	0.06
421	603806	福斯特	3,700	47,952.00	0.06
422	002244	滨江集团	4,900	47,775.00	0.06

423	688188	柏楚电子	360	47,397.60	0.05
424	000830	鲁西化工	4,600	47,380.00	0.05
425	002432	九安医疗	1,300	47,359.00	0.05
426	600008	首创环保	15,600	47,112.00	0.05
427	002064	华峰化学	7,100	46,931.00	0.05
428	000629	钒钛股份	18,300	46,848.00	0.05
429	600516	方大炭素	10,000	46,400.00	0.05
430	000708	中信特钢	3,900	45,864.00	0.05
431	600763	通策医疗	1,100	45,408.00	0.05
432	600535	天士力	2,900	45,385.00	0.05
433	600170	上海建工	18,900	45,171.00	0.05
434	000818	航锦科技	2,000	45,000.00	0.05
435	002439	启明星辰	2,800	44,772.00	0.05
436	600859	王府井	3,200	44,448.00	0.05
437	002176	江特电机	6,100	44,286.00	0.05
438	600499	科达制造	4,500	44,100.00	0.05
439	600323	瀚蓝环境	1,800	43,830.00	0.05
440	600511	国药股份	1,500	43,740.00	0.05
441	603816	顾家家居	1,700	43,384.00	0.05
442	600325	华发股份	8,900	43,343.00	0.05
443	603885	吉祥航空	3,200	43,104.00	0.05
444	000563	陕国投 A	12,000	42,840.00	0.05
445	601966	玲珑轮胎	2,900	42,543.00	0.05
446	603000	人民网	2,100	42,441.00	0.05
447	300567	精测电子	700	42,427.00	0.05
448	601880	辽港股份	28,200	42,300.00	0.05
448	002603	以岭药业	3,000	42,300.00	0.05
450	688005	容百科技	1,855	41,403.60	0.05
451	002756	永兴材料	1,300	41,275.00	0.05
452	000547	航天发展	4,900	41,160.00	0.05
453	300529	健帆生物	1,900	40,983.00	0.05

454	603077	和邦生物	23,200	40,600.00	0.05
455	603899	晨光股份	1,400	40,586.00	0.05
456	600655	豫园股份	7,300	40,515.00	0.05
457	600754	锦江酒店	1,800	40,392.00	0.05
458	300390	天华新能	2,100	40,047.00	0.05
459	600004	白云机场	4,400	40,040.00	0.05
460	002544	普天科技	1,700	39,865.00	0.05
461	002145	中核钛白	9,600	39,840.00	0.05
462	603833	欧派家居	700	39,515.00	0.05
463	000998	隆平高科	4,000	39,400.00	0.05
464	300070	碧水源	8,700	39,150.00	0.05
465	600131	国网信通	2,200	38,940.00	0.04
466	300601	康泰生物	2,500	37,975.00	0.04
467	600867	通化东宝	4,600	37,720.00	0.04
468	601866	中远海发	15,200	37,544.00	0.04
469	002120	韵达股份	5,600	37,520.00	0.04
470	600667	太极实业	5,600	36,848.00	0.04
471	000032	深桑达 A	1,800	36,414.00	0.04
472	300438	鹏辉能源	1,300	35,893.00	0.04
473	300118	东方日升	3,700	35,446.00	0.04
474	000967	盈峰环境	5,100	35,445.00	0.04
475	600258	首旅酒店	2,500	35,325.00	0.04
476	002831	裕同科技	1,500	35,130.00	0.04
477	000069	华侨城 A	15,600	35,100.00	0.04
478	300751	迈为股份	500	34,780.00	0.04
479	002508	老板电器	1,800	34,218.00	0.04
480	002266	浙富控股	10,900	33,572.00	0.04
481	300573	兴齐眼药	640	33,145.60	0.04
482	603650	彤程新材	1,000	32,150.00	0.04
483	688063	派能科技	712	32,096.96	0.04
484	600129	太极集团	1,500	31,965.00	0.04

485	601636	旗滨集团	6,200	31,062.00	0.04
486	002572	索菲亚	2,200	30,822.00	0.04
487	002292	奥飞娱乐	3,100	30,132.00	0.03
488	300457	赢合科技	1,300	29,900.00	0.03
489	000035	中国天楹	6,900	29,601.00	0.03
490	600864	哈投股份	4,900	29,253.00	0.03
491	002372	伟星新材	2,600	26,936.00	0.03
492	002091	江苏国泰	3,700	26,899.00	0.03
493	300769	德方纳米	800	26,416.00	0.03
494	688390	固德威	600	26,070.00	0.03
495	600315	上海家化	1,200	25,284.00	0.03
496	001914	招商积余	1,400	17,318.00	0.02
497	600007	中国国贸	800	16,464.00	0.02
498	600335	国机汽车	2,400	15,480.00	0.02
499	301381	赛维时代	300	5,985.00	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的股票。

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末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	4,082,039.00	4.71
2	300750	宁德时代	2,873,631.00	3.32
3	601318	中国平安	2,328,746.00	2.69
4	600036	招商银行	2,212,766.00	2.55
5	000333	美的集团	1,494,412.00	1.72
6	601166	兴业银行	1,466,803.00	1.69
7	600900	长江电力	1,442,004.00	1.66

8	002594	比亚迪	1,365,467.00	1.58
9	300059	东方财富	1,229,092.00	1.42
10	601899	紫金矿业	1,159,379.00	1.34
11	600030	中信证券	1,120,816.00	1.29
12	000858	五粮液	1,078,746.00	1.24
13	601398	工商银行	1,017,437.00	1.17
14	600276	恒瑞医药	887,828.60	1.02
15	002475	立讯精密	866,309.00	1.00
16	601328	交通银行	825,097.00	0.95
17	000651	格力电器	817,585.00	0.94
18	688981	中芯国际	809,451.00	0.93
19	600887	伊利股份	750,602.00	0.87
20	601816	京沪高铁	698,365.00	0.81

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

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	744,525.00	0.86
2	300750	宁德时代	455,071.00	0.53
3	601318	中国平安	414,537.00	0.48
4	600036	招商银行	390,791.00	0.45
5	600900	长江电力	255,973.00	0.30
6	000333	美的集团	245,071.00	0.28
7	601988	中国银行	239,712.00	0.28
8	601166	兴业银行	235,746.00	0.27
9	601899	紫金矿业	210,089.00	0.24
10	002594	比亚迪	206,282.00	0.24

11	300059	东方财富	191,331.00	0.22
12	600030	中信证券	180,347.00	0.21
13	601398	工商银行	178,591.00	0.21
14	600276	恒瑞医药	162,587.00	0.19
15	000858	五 粮 液	161,156.00	0.19
16	300124	汇川技术	153,762.00	0.18
17	000651	格力电器	141,497.00	0.16
18	601328	交通银行	131,168.00	0.15
19	600887	伊利股份	127,764.00	0.15
20	601288	农业银行	127,062.00	0.15

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

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	96,780,171.61
卖出股票收入（成交）总额	14,848,189.29

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

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

本基金本报告期未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券中，兴业银行在报告编制日前一年内受过公开处罚，本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

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

7.12.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

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	27,485.56
2	应收清算款	892,861.86
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	920,347.42

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未存在流通受限情况。

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

份额 级别	持 有 人 户 数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
汇安 中证A 500指 数A	72	48,900.92	0.00	0.00%	3,520,865.92	100.00%
汇安 中证A 500指 数C	751	109,628.88	0.00	0.00%	82,331,292.23	100.00%
合计	811	105,859.63	0.00	0.00%	85,852,158.15	100.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数	占基金总份额比

		(份)	例
基金管理人所有从业人员持有本基金	汇安中证A500指数A	0.00	0.0000%
	汇安中证A500指数C	0.00	0.0000%
	合计	0.00	0.0000%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	汇安中证A500指数A	汇安中证A500指数C
基金合同生效日(2025年01月24日)基金份额总额	12,048,516.92	210,904,373.13
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	225,565.19	6,443,740.44
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	8,753,216.19	135,016,821.34
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-

本报告期期末基金份额总额	3,520,865.92	82,331,292.23
--------------	--------------	---------------

注：1. 申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 本基金自2024年12月24日至2025年1月21日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币222,905,833.65元，折合为222,905,833.65份基金份额(其中A类基金份额12,045,372.58份，C类基金份额210,860,461.07份)。根据《汇安中证A500指数证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币47,056.40元在本基金成立后，折合为47,056.40份基金份额(其中A类基金份额3,144.34份，C类基金份额43,912.06份)，划入基金份额持有人账户。

3. 根据《汇安中证A500指数证券投资基金基金合同》、《汇安中证A500指数证券投资基金招募说明书》及《汇安中证A500指数证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告》的相关规定，本基金于2025年1月24日(基金合同生效日)至2025年2月23日止期间暂不向投资人开放基金交易，申购业务、赎回业务和转换业务自2025年2月24日起开始办理。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金在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

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

2025年1月，中国光大银行股份有限公司聘任贾光华先生担任资产托管部总经理职务。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、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

本基金在报告期内基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金成立日（2025年1月24日）起至今聘任容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本报告期内未发生变动。

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

本报告期，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
天风 证券	2	111,628,360.90	100.0 0%	20,753.86	100.0 0%	-
中信 证券	2	-	-	-	-	-

注：

选择专用席位的标准和程序：

(1) 选择标准

- 1、综合实力较强、市场信誉良好；
- 2、财务状况良好，经营状况稳健；
- 3、经营行为规范，具备健全的内部控制制度；
- 4、研究实力较强，并能够第一时间提供丰富的高质量研究咨询报告，并能根据特定要求提供定制研究报告；能够积极进行业务交流，定期进行观点交流和路演；能够提供实地调研等多种类型的研究服务；
- 5、具有佣金费率优势，具备支持交易的安全、稳定、便捷、高效的通讯条件和交易环境，能提供全面的交易信息服务；
- 6、从制度上和技术上保证管理人租用交易单元的交易信息严格保密。

(2) 选择程序

- 1、本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的券商。
- 2、本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议。

(3) 交易单元变更情况

本基金本报告期内新增交易单元:天风证券2个、中信证券2个。

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		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
天风证券	-	-	818,767,00 0.00	100.0 0%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	汇安中证A500指数证券投资 基金基金合同生效公告	规定报刊和/或公司网站	2025-01-25
2	汇安中证A500指数证券投资 基金开放日常申购、赎回、 转换及定期定额投资业务的 公告	规定报刊和/或公司网站	2025-02-21
3	汇安中证A500指数证券投资 基金2025年第1季度报告	规定报刊和/或公司网站	2025-04-22
4	汇安基金管理有限责任公司 关于网上直销平台系统维护 的公告	规定报刊和/或公司网站	2025-05-23

§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

本基金本报告期内未存在单一基金份额持有人持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准汇安中证A500指数证券投资基金募集的文件
- (2) 《汇安中证A500指数证券投资基金基金合同》
- (3) 《汇安中证A500指数证券投资基金招募说明书》
- (4) 《汇安中证A500指数证券投资基金托管协议》
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (6) 在规定报刊及规定网站上披露的各项公告
- (7) 中国证监会规定的其他文件

12.2 存放地点

北京市东城区东直门南大街5号中青旅大厦13层

上海市虹口区东大名路501白玉兰大厦36层

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所及网站免费查阅备查文件，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复印件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人汇安基金管理有限责任公司，客户服务电话010-56711690。

公司网站：<http://www.huianfund.cn>

汇安基金管理有限责任公司
二〇二五年八月三十日