

国投瑞银中证 500 指数量化增强型证券投资基金

2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：国投瑞银基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年八月三十日

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。

基金托管人中国农业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、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 2024 年 1 月 1 日起至 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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
4 管理人报告	10
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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	55
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	56
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	56
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	56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.12 投资组合报告附注	56

8 基金份额持有人信息	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	58
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的情况.....	58
9 开放式基金份额变动	58
10 重大事件揭示	59
10.1 基金份额持有人大会决议.....	59
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.....	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	59
10.4 基金投资策略的改变.....	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
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.....	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	59
10.8 其他重大事件.....	60
11 影响投资者决策的其他重要信息	61
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.....	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	61
12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录.....	61
12.2 存放地点.....	62
12.3 查阅方式.....	62

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国投瑞银中证 500 指数量化增强型证券投资基金	
基金简称	国投瑞银中证 500 指数量化增强	
基金主代码	005994	
交易代码	005994	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 8 月 1 日	
基金管理人	国投瑞银基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	732,266,690.24 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国投瑞银中证 500 指数量化增强 A	国投瑞银中证 500 指数量化增强 C
下属分级基金的交易代码	005994	007089
报告期末下属分级基金的份额总额	510,536,095.89 份	221,730,594.35 份

2.2 基金产品说明

投资目标	<p>本基金为指数增强型股票基金，通过数量化的方法进行积极的组合管理和严格的风险控制，在对标的指数进行有效跟踪的基础上，力争获取高于标的指数的超额收益。</p>
投资策略	<p>本基金采用指数增强型投资策略，以中证 500 指数为基金的标的指数，结合深入的宏观和基本面研究、以及量化投资技术，在跟踪指数的基础上调整投资组合，力争在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。</p> <p>（一）类别资产配置</p> <p>本基金为股票指数增强型证券投资基金，股票资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于标的指数成份股或备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%。</p> <p>（二）股票投资管理</p> <p>1、指数化投资策略</p> <p>本基金将运用类指数化的投资方法，通过控制对各成份股在标的指数中权重的偏离，实现跟踪误差控制目标，达到对标的指数的跟踪目标。</p> <p>2、量化增强策略</p> <p>本基金在有效跟踪标的指数的基础上，通过量化投资技术，力争实现高于标的指数的投资收益。</p> <p>3、股票组合调整</p> <p>股票组合调整采用定期调整与不定期调整。</p> <p>（三）债券投资管理</p>

	<p>本基金采取“自上而下”的债券分析方法，确定债券投资组合，并管理组合风险。本基金债券投资策略主要包括：久期策略、收益率曲线策略、类别选择策略和个券选择策略。</p> <p>（四）股指期货投资策略</p> <p>为更好地实现投资目标，本基金在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，适度运用股指期货。本基金利用股指期货流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，提高投资组合的运作效率。</p> <p>（五）权证投资策略</p> <p>1、考量标的股票合理价值、标的股票价格、行权价格、行权时间、行权方式、股价历史与预期波动率和无风险收益率等要素，估计权证合理价值。</p> <p>2、根据权证合理价值与其市场价格间的差幅即“估值差价(Value Price)”以及权证合理价值对定价参数的敏感性，结合标的股票合理价值考量，决策买入、持有或沽出权证。</p> <p>（六）对于资产支持证券，其定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，以数量化模型确定其内在价值。</p>
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税前）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

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		国投瑞银基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王明辉	任航
	联系电话	400-880-6868	010-66060069
	电子邮箱	service@ubssdic.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-880-6868	95599
传真		0755-82904048	010-68121816
注册地址		上海市虹口区杨树浦路168号 20层	北京东城区建国门内大街69号
办公地址		深圳市福田区福华一路119号 安信金融大厦18楼	北京市西城区复兴门内大街28 号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		518046	100031
法定代表人		傅强	谷澍

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	http://www.ubssdic.com
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	国投瑞银基金管理有限公司	深圳市福田区福华一路 119 号安信金融大厦 18 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 日至 2024 年 6 月 30 日）	
	国投瑞银中证 500 指数 量化增强 A	国投瑞银中证 500 指数量 化增强 C
本期已实现收益	-3,477,154.77	-3,128,712.49
本期利润	-40,078,334.07	-18,073,420.02
加权平均基金份额本期利润	-0.0776	-0.0763
本期加权平均净值利润率	-4.24%	-4.26%
本期基金份额净值增长率	-4.24%	-4.43%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
	国投瑞银中证 500 指数量 化增强 A	国投瑞银中证 500 指数量 化增强 C
期末可供分配利润	396,378,542.86	163,837,554.54
期末可供分配基金份额利润	0.7764	0.7389
期末基金资产净值	906,914,638.75	385,568,148.89
期末基金份额净值	1.7764	1.7389
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
	国投瑞银中证 500 指数 量化增强 A	国投瑞银中证 500 指数量 化增强 C
基金份额累计净值增长率	77.64%	49.52%

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、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的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3、以上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（例如基金申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际利润水平要低于所列数字。

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

国投瑞银中证 500 指数量化增强 A

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	-4.87%	0.90%	-6.55%	0.91%	1.68%	-0.01%
过去三个月	-3.32%	1.04%	-6.16%	1.09%	2.84%	-0.05%
过去六个月	-4.24%	1.49%	-8.46%	1.53%	4.22%	-0.04%
过去一年	-12.20%	1.17%	-16.71%	1.21%	4.51%	-0.04%
过去三年	-20.06%	1.12%	-26.00%	1.14%	5.94%	-0.02%
自基金合同生效起至今	77.64%	1.18%	-3.81%	1.28%	81.45%	-0.10%

国投瑞银中证 500 指数量化增强 C

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	-4.91%	0.90%	-6.55%	0.91%	1.64%	-0.01%
过去三个月	-3.42%	1.04%	-6.16%	1.09%	2.74%	-0.05%
过去六个月	-4.43%	1.49%	-8.46%	1.53%	4.03%	-0.04%
过去一年	-12.55%	1.17%	-16.71%	1.21%	4.16%	-0.04%
过去三年	-21.01%	1.12%	-26.00%	1.14%	4.99%	-0.02%
自基金合同生效起至今	49.52%	1.21%	-7.90%	1.23%	57.42%	-0.02%

注：1、本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税前）×5%。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3、本基金于 2019 年 3 月 14 日起增加 C 类基金份额，本基金 C 类基金份额报告期间的起始日为 2019 年 3 月 14 日。

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

国投瑞银中证 500 指数量化增强型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2018 年 8 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日）

国投瑞银中证 500 指数量化增强 A



国投瑞银中证 500 指数量化增强 C



注：本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

本基金于 2019 年 3 月 14 日起增加 C 类基金份额，本基金 C 类基金份额报告期间的起始日为 2019 年 3 月 14 日。

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

国投瑞银基金管理有限公司（以下简称“公司”）前身为中融基金管理有限公司，经中国证券监督管理委员会批准，于 2005 年 6 月 8 日合资成立，注册资本 1 亿元人民币。公司是境内第一家外方持股比例达到 49% 的合资基金公司，公司股东为国投泰康信托有限公司（国家开发投资公司的控股子公司）及瑞士银行股份有限公司（UBS AG）。公司拥有完善的法人治理结构，建立了有效的风险管理及控制架构，以“诚信、创新、包容、客户关注”作为公司的企业文化。公司目前已建立较为完整的产品线，产品涵盖股票型、混合型、债券型、货币型、指数型、QDII 型、FOF 型、商品型等类型，为投资者提供多样化选择，满足不同风险偏好的投资需求。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
殷瑞飞	本基金基金经理，量化投资部部门副总经理	2018-08-01	-	16	基金经理，量化投资部部门副总经理，中国籍，厦门大学统计学博士。16 年证券从业经历。2008 年 3 月至 2011 年 6 月任汇添富基金管理有限公司风险管理分析师。2011 年 6 月加入国投瑞银基金管理有限公司。2013 年 4 月 2 日至 2013 年 9 月 25 日担任国投瑞银瑞和沪深 300 指数分级证券投资基金的基金经理助理，2013 年 5 月 17 日至 2013 年 9 月 25 日担任国投瑞银沪深 300 金融地产指数证券投资基金（LOF）的基金经理助理。2014 年 7 月 24 日起担任国投瑞银中证上游资源产业指数证券投资基金（LOF）基金经理，2018 年 8 月 1 日起兼任国投瑞银中证 500 指数量化增强型证券投资基金基金经理，2019 年 6 月 11 日起兼任国投瑞银沪深 300 指数量化增强型证券投资基金基金经理，2023 年 10 月 26 日起兼任国投瑞银新增长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。曾于 2016 年 4 月 26 日至

					<p>2018 年 6 月 11 日期间担任国投瑞银新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理，于 2015 年 11 月 17 日至 2019 年 1 月 4 日期间担任国投瑞银新收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理，于 2013 年 9 月 26 日至 2020 年 9 月 18 日期间担任国投瑞银瑞和沪深 300 指数分级证券投资基金基金经理，于 2013 年 10 月 26 日至 2023 年 7 月 14 日期间担任国投瑞银沪深 300 金融地产交易型开放式指数证券投资基金 (LOF) 基金经理，于 2021 年 10 月 15 日至 2024 年 1 月 10 日期间兼任国投瑞银安睿混合型证券投资基金基金经理，于 2022 年 12 月 5 日至 2024 年 6 月 3 日期间兼任国投瑞银专精特新量化选股混合型证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

注：任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日。证券从业年限计算标准遵从中国证监会《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》中关于证券投资基金从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在报告期内，本基金管理人遵守《证券法》、《证券投资基金法》及其系列法规和本基金《基金合同》等有关规定，本着恪守诚信、审慎勤勉，忠实尽职的原则，为基金份额持有人的利益管理和运用基金资产。在报告期内，基金的投资决策规范，基金运作合法合规，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，管理人通过制度、流程和技术手段保证了公平交易原则的实现，确保本基金管理人旗下各投资组合在研究、决策、交易执行等各方面均得到公平对待，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督，形成了有效地公平交易体系。本报告期，本基金管理人各项公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的现象。

报告期内，管理人于每季度和年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别

（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。本年度同向交易价差专项分析的情况如下：

1、管理人对所有投资组合在过去连续四个季度内同向交易相同证券的交易价差的溢价率进行分析，对两两组合同向交易成交价格均值的溢价率是否趋近于零进行 T 检验，检验在 95% 的可信水平下，价格均值的溢价率趋近于零是否存在检验不通过的情况。

2、管理人对所有投资组合在过去连续四个季度内同向交易相同证券的交易价差优劣进行比较，区分买优、卖优、买次、卖次等情况分别分析两两组合在期间内交易时是否存在显著优于另一方的异常情况。

3、管理人对所有投资组合在过去连续四个季度内同向交易相同证券的交易价差区分两两组合进行利益输送的模拟测算，检查在过去四个季度内，是否存在显著异常的情况。

检验分析结果显示，公司管理的所有投资组合，在过去连续四个季度内未发现存在违反公平交易原则的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

基金管理人管理的所有投资组合在本报告期内未出现参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量 5% 的交易情况。

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

回顾 2024 年上半年，海外方面，美国经济保持强劲，降息预期波动，地缘政治冲突加剧。国内经济经历了先升后降的波动，表现出外强内弱的格局，实际下行压力较大。政策上，政府采取了温和发力、节奏偏慢的策略，并对房地产市场进行了适度放松。

市场方面，A 股整体保持震荡，更多以结构性行情为主。从风格来看，红利和大盘风格依旧延续强势表现，上证指数下跌 0.25%，沪深 300 指数上涨 0.89%，中证红利指数上涨 7.75%，中证 1000 指数下跌 16.84%。不同行业赛道分化也较为明显，银行、煤炭代表的股息率较高的行业领涨，通信、电子等行业受人工智能概念的影响，也有不错的表现。

基金投资操作上，作为量化指数增强基金，我们将继续坚持以多因子选股模型为主体，其它量化投资策略为补充的科学数量化方法，广范围、高效率地寻找市场中错误定价带来的投资机会，基于系统化、纪律化的投资体系严格控制跟踪误差，争取获得持续稳健的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 类份额净值为 1.7764 元，C 类份额净值为 1.7389 元。本报告期 A 类份额净值增长率为-4.24%，C 类份额净值增长率为-4.43%；本报告期同期业绩比较基准收益率为-8.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，外需、价格、地产和社融等方面均存在不确定性。政策上，预计会有增量政策出台，但不会是强刺激，重点将放在促进改革、财政发力、货币加杠杆和金融强监管上。经济基本面可能延续外强内弱的特征，政策将更加注重固本培元和底线思维。海外市场并不平静，需关注美国经济的软着陆、降息预期以及地缘冲突的升级可能性。资产端，需关注美联储的降息节奏和地缘政治的博弈对市场的潜在影响。权益市场可能仍以结构性、主题性行情为主。总体来看，当前主要指数估值水平仍处于历史均值水位以下，具备中长期配置的吸引力，我们认为，A 股市场整体机会仍大于风险。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人从事基金估值业务的组织机构主要包括估值委员会、运营部及相关部门。

本基金的日常估值程序通常由运营部估值核算岗执行并由业务复核岗复核估值结果，最终由估值核算员与产品托管人的估值结果核对一致。

本基金的特别估值程序由估值委员会秘书部门运营部在收到启动特殊估值程序的请求后，应通过估值核算人员及时与基金托管人沟通协商，必要时征求会计师事务所的专业意见，并将有关信息及材料一并报送全体估值委员会成员；估值委员会应综合考虑投资部门、研究部和运营部等各方面的意见和建议，并按照有关议事规则讨论审议，决定批准或不批准使用特殊估值调整；运营部应当根据经估值委员会审议通过的特别估值调整意见执行估值程序，准备特殊估值调整事项的临时公告，并发起信息披露审批流程；法律合规部应当对特殊估值调整事项的相关信息披露进行合规审核。

截止报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司建立业务合作关系，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截至本报告期末，根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，本基金本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

无。

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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—国投瑞银基金管理有限公司 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，国投瑞银基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，国投瑞银基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

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：国投瑞银中证 500 指数量化增强型证券投资基金

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	上年度末
----	-----	-----	------

		2024 年 6 月 30 日	2023 年 12 月 31 日
资产：		-	-
货币资金	6.4.7.1	69,562,973.74	81,251,623.96
结算备付金		17,568,263.98	16,824,774.66
存出保证金		171,317.67	416,756.53
交易性金融资产	6.4.7.2	1,208,758,873.92	1,340,604,731.00
其中：股票投资		1,208,758,873.92	1,340,421,028.21
基金投资		-	-
债券投资		-	183,702.79
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		118,768.36	-
应收股利		-	-
应收申购款		639,232.54	877,616.95
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	35,030.84	29,280.40
资产总计		1,296,854,461.05	1,440,004,783.50
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		13,343.70	-
应付赎回款		407,350.81	872,342.37
应付管理人报酬		1,094,343.88	1,205,259.89
应付托管费		164,151.59	180,788.99
应付销售服务费		130,790.62	156,968.12
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.32	515.53
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	2,561,692.49	3,785,627.35
负债合计		4,371,673.41	6,201,502.25
净资产：		-	-
实收基金	6.4.7.7	732,266,690.24	777,846,771.77
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	560,216,097.40	655,956,509.48

净资产合计		1,292,482,787.64	1,433,803,281.25
负债和净资产总计		1,296,854,461.05	1,440,004,783.50

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，国投瑞银中证 500 指数量化增强 A 类基金份额净值人民币 1.7764 元，国投瑞银中证 500 指数量化增强 C 类基金份额净值人民币 1.7389 元，基金份额总额 732,266,690.24 份。其中国投瑞银中证 500 指数量化增强 A 类基金份额 510,536,095.89 份；国投瑞银中证 500 指数量化增强 C 类基金份额 221,730,594.35 份。

6.2 利润表

会计主体：国投瑞银中证 500 指数量化增强型证券投资基金

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
一、营业总收入		-49,245,626.11	62,424,329.17
1.利息收入		446,003.76	524,827.35
其中：存款利息收入	6.4.7.9	446,003.76	524,827.35
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）		1,729,708.25	12,948,110.61
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-16,919,992.74	-4,851,297.36
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	98,262.30	1,692,656.06
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	2,154,360.99	396,427.76
股利收益	6.4.7.16	16,397,077.70	15,710,324.15
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-51,545,886.83	48,568,136.65
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	124,548.71	383,254.56
减：二、营业总支出		8,906,127.98	10,791,298.32
1. 管理人报酬		6,806,946.75	8,420,077.09
2. 托管费		1,021,042.02	1,263,011.61
3. 销售服务费		844,205.46	848,510.88
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	6.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		7,758.48	2,132.65
8. 其他费用	6.4.7.20	226,175.27	257,566.09
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-58,151,754.09	51,633,030.85
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-58,151,754.09	51,633,030.85
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-58,151,754.09	51,633,030.85

6.3 净资产变动表

会计主体：国投瑞银中证 500 指数量化增强型证券投资基金

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（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	777,846,771.77	-	655,956,509.48	1,433,803,281.25
二、本期期初净资产	777,846,771.77	-	655,956,509.48	1,433,803,281.25
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-45,580,081.53	-	-95,740,412.08	-141,320,493.61
（一）、综合收益总额	-	-	-58,151,754.09	-58,151,754.09
（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）	-45,580,081.53	-	-37,588,657.99	-83,168,739.52
其中：1.基金申购款	66,054,148.15	-	51,956,302.89	118,010,451.04
2.基金赎回款	-111,634,229.68	-	-89,544,960.88	-201,179,190.56
（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	732,266,690.24	-	560,216,097.40	1,292,482,787.64
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（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	854,984,856.84	-	823,664,942.53	1,678,649,799.37
二、本期期初净资产	854,984,856.84	-	823,664,942.53	1,678,649,799.37
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-109,312,373.88	-	-67,060,883.28	-176,373,257.16
（一）、综合收益总额	-	-	51,633,030.85	51,633,030.85
（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）	-109,312,373.88	-	-118,693,914.13	-228,006,288.01
其中：1.基金申购款	203,589,467.17	-	212,351,551.95	415,941,019.12
2.基金赎回款	-312,901,841.05	-	-331,045,466.08	-643,947,307.13
（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	745,672,482.96	-	756,604,059.25	1,502,276,542.21

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：

基金管理人负责人：王彦杰，主管会计工作负责人：王彦杰，会计机构负责人：冯伟

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国投瑞银中证 500 指数量化增强型证券投资基金(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[2018]463 号《关于核准国投瑞银中证 500 指数量化增强型证券

投资基金注册的批复》核准，由基金管理人国投瑞银基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国投瑞银中证 500 指数量化增强型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基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 612,674,139.95 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(2018)第 0454 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国投瑞银中证 500 指数量化增强型证券投资基金基金合同》于 2018 年 8 月 1 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 612,977,736.48 份基金份额，其中认购资金利息折合 303,596.53 份基金份额。本基金的基金管理人为国投瑞银基金管理有限公司，注册登记机构为国投瑞银基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称"中国农业银行")。

根据国投瑞银基金管理有限公司 2019 年 3 月 13 日发布的《关于国投瑞银中证 500 指数量化增强型基金增加 C 类基金份额并修改基金合同的公告》及修改后的《国投瑞银中证 500 指数量化增强型证券投资基金基金合同》的规定，本基金自 2019 年 3 月 14 日起增设 C 类基金份额。本基金根据申购费、销售服务费收取方式的不同，将本基金的基金份额分为 A 类基金份额、C 类基金份额。在本基金的基金份额分类实施后，本基金的原有基金份额全部自动划归为本基金 A 类基金份额，A 类基金份额在投资者申购时收取申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费；本基金新增加的 C 类基金份额类别，在投资者申购时不收取申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费。本基金 A 类基金份额和 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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国投瑞银中证 500 指数量化增强型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，包括国内依法上市的股票(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票、存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转债(含可分离交易可转换债券)、可交换债券、次级债、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金股票资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于标的指数成份股或备选成份股的资产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，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，上述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的标的指数为中证 500 指数。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税前)×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年中期的经营成果和基金净值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

本基金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	69,562,973.74
等于：本金	69,550,467.97
加：应计利息	12,505.77
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-

存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	69,562,973.74

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	1,295,946,586.93	-	1,208,758,873.92	-87,187,713.01
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	1,295,946,586.93	-	1,208,758,873.92	-87,187,713.01

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

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	35,030.84
待摊费用	-
合计	35,030.84

6.4.7.6 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	346.99
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,397,298.16
其中：交易所市场	2,397,298.16
银行间市场	-
应付利息	-
信息披露费	59,672.34
指数使用费	54,648.96
审计费用	49,726.04
合计	2,561,692.49

6.4.7.7 实收基金

国投瑞银中证 500 指数量化增强 A

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	账面金额
上年度末	521,589,269.51	521,589,269.51
本期申购	48,885,583.35	48,885,583.35
本期赎回（以“-”号填列）	-59,938,756.97	-59,938,756.97
本期末	510,536,095.89	510,536,095.89

国投瑞银中证 500 指数量化增强 C

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	账面金额
上年度末	256,257,502.26	256,257,502.26

本期申购	17,168,564.80	17,168,564.80
本期赎回（以“-”号填列）	-51,695,472.71	-51,695,472.71
本期末	221,730,594.35	221,730,594.35

注：申购含红利再投、转换入份额,赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

国投瑞银中证 500 指数量化增强 A

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	510,260,361.30	-64,302,995.40	445,957,365.90
本期期初	510,260,361.30	-64,302,995.40	445,957,365.90
本期利润	-3,477,154.77	-36,601,179.30	-40,078,334.07
本期基金份额交易产生的变动数	-10,650,254.37	1,149,765.40	-9,500,488.97
其中：基金申购款	46,582,122.20	-7,443,097.32	39,139,024.88
基金赎回款	-57,232,376.57	8,592,862.72	-48,639,513.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	496,132,952.16	-99,754,409.30	396,378,542.86

国投瑞银中证 500 指数量化增强 C

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	248,073,697.50	-38,074,553.92	209,999,143.58
本期期初	248,073,697.50	-38,074,553.92	209,999,143.58
本期利润	-3,128,712.49	-14,944,707.53	-18,073,420.02
本期基金份额交易产生的变动数	-32,510,277.18	4,422,108.16	-28,088,169.02
其中：基金申购款	16,178,621.90	-3,361,343.89	12,817,278.01
基金赎回款	-48,688,899.08	7,783,452.05	-40,905,447.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	212,434,707.83	-48,597,153.29	163,837,554.54

6.4.7.9 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	289,698.36
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	148,133.75
其他	8,171.65
合计	446,003.76

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,288,925,859.99
减：卖出股票成本总额	2,300,148,734.66
减：交易费用	5,697,118.07
买卖股票差价收入	-16,919,992.74

6.4.7.11 基金投资收益

无。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 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	68.50
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	98,193.80
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	98,262.30

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	353,943.39
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	255,643.50
减：应计利息总额	91.91
减：交易费用	14.18
买卖债券差价收入	98,193.80

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益	2,154,360.99

6.4.7.16 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	16,397,077.70
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	16,397,077.70

6.4.7.17 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	-51,545,886.83
——股票投资	-51,545,849.04
——债券投资	-37.79
——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	-51,545,886.83

6.4.7.18 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	123,000.14
基金转换费收入	1,548.57
合计	124,548.71

6.4.7.19 信用减值损失

无。

6.4.7.20 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	49,726.04
信息披露费	59,672.34
银行汇划费	7,865.69
指数使用费	108,911.20
合计	226,175.27

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国投瑞银基金管理有限公司（“国投瑞银基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
国投证券股份有限公司（“国投证券”）	与基金管理人受同一实际控制的公司、基金销售机构
瑞银证券有限责任公司（“瑞银证券”）	基金管理人股东的控股子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

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
瑞银证券	546,776,915.75	12.13%	-	-

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

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
瑞银证券	517,202.56	12.13%	311,962.72	13.01%
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
瑞银证券	-	-	-	-

注：1.上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，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。

2.该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

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	6,806,946.75	8,420,077.09
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,512,964.78	2,719,409.61
应支付基金管理人的净管理费	4,293,981.97	5,700,667.48

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

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托管费	1,021,042.02	1,263,011.61

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

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 2024年1月1日至2024年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国投瑞银中证 500 指 数量化增强 A	国投瑞银中证 500 指数量 化增强 C	合计
国投证券	-	4,057.78	4,057.78
国投瑞银基金	-	112,918.71	112,918.71

合计	-	116,976.49	116,976.49
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国投瑞银中证500指数量化增强A	国投瑞银中证500指数量化增强C	合计
国投瑞银基金	-	223,607.35	223,607.35
国投证券	-	5,442.38	5,442.38
合计	-	229,049.73	229,049.73

注：本基金 C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%，销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times C \text{ 类基金份额的销售服务费年费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日 C 类基金份额应计提的销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额的基金资产净值

C 类基金份额的销售服务费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。基金销售服务费用用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等。

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自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 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
中国农业银行	69,562,973.74	289,698.36	86,415,860.62	354,979.97

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

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

无。

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

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
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：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001359	平安电工	2024-03-19	1-6个月(含)	新股锁定	17.39	20.60	184.00	3,199.76	3,790.40	-
001379	腾达科技	2024-01-11	1-6个月(含)	新股锁定	16.98	13.48	213.00	3,616.74	2,871.24	-
001387	雪祺电气	2024-01-04	1-6个月(含)	新股锁定	15.38	15.25	173.00	2,045.54	2,638.25	-
001389	广合科技	2024-03-26	1-6个月(含)	新股锁定	17.43	34.56	222.00	3,869.46	7,672.32	-
301502	华阳智能	2024-01-26	1-6个月(含)	新股锁定	28.01	37.83	138.00	3,865.38	5,220.54	-
301536	星辰科技	2024-03-20	1-6个月(含)	新股锁定	16.16	32.27	481.00	7,772.96	15,521.87	-
301538	骏鼎达	2024-03-13	1-6个月(含)	新股锁定	55.82	91.24	150.00	5,972.74	13,686.00	-

301539	宏鑫科技	2024-04-03	1-6个月(含)	新股锁定	10.64	19.82	361.00	3,841.04	7,155.02	-
301566	达利凯普	2023-12-22	1-6个月(含)	新股锁定	8.90	16.97	576.00	5,126.40	9,774.72	-
301587	中瑞股份	2024-03-27	1-6个月(含)	新股锁定	21.73	25.26	306.00	6,649.38	7,729.56	-
301588	美新科技	2024-03-06	1-6个月(含)	新股锁定	14.50	21.25	257.00	3,726.50	5,461.25	-
301589	诺瓦星云	2024-02-01	1-6个月(含)	新股锁定	126.89	188.01	1,244.00	87,680.99	233,884.44	-
301591	肯特股份	2024-02-20	1-6个月(含)	新股锁定	19.43	36.98	219.00	4,255.17	8,098.62	-
601033	永兴股份	2024-01-11	1-6个月(含)	新股锁定	16.20	15.96	1,258.00	20,379.60	20,077.68	-
603082	北自科技	2024-01-23	1-6个月(含)	新股锁定	21.28	29.49	107.00	2,276.96	3,155.43	-
603312	西典新能	2024-01-04	1-6个月(含)	新股锁定	29.02	25.36	130.00	3,772.60	3,296.80	-
603325	博隆技术	2024-01-03	1-6个月(含)	新股锁定	72.46	68.06	66.00	4,782.36	4,491.96	-
603341	龙旗科技	2024-02-23	1-6个月(含)	新股锁定	26.00	37.49	298.00	7,748.00	11,172.02	-
603344	星德胜	2024-03-13	1-6个月(含)	新股锁定	19.18	22.66	182.00	3,490.76	4,124.12	-
603375	盛景微	2024-01-17	1-6个月(含)	新股锁定	38.18	38.90	72.00	2,748.96	2,800.80	-
688584	上海合晶	2024-02-01	1-6个月(含)	新股锁定	22.66	15.89	866.00	19,623.56	13,760.74	-
688691	灿芯股份	2024-04-02	1-6个月	新股锁定	19.86	42.51	247.00	4,905.42	10,499.97	-

			(含)							
688695	中创股份	2024-03-06	1-6 个月(含)	新股锁定	22.43	31.55	186.00	4,171.98	5,868.30	-
688709	成都华微	2024-01-31	1-6 个月(含)	新股锁定	15.69	18.79	1,045.00	16,396.05	19,635.55	-
688717	艾罗能源	2023-12-26	1-6 个月(含)	新股锁定	55.66	47.02	11,303.00	629,124.98	531,467.06	-

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

本基金为指数增强型股票基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转债（含可分离交易可转换债券）、可交换债券、次级债、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金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，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是通过控制上述风险，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。本基金管理人秉承全面风险控制的

理念，将风险管理融入业务中，使风险控制与投资业务紧密结合，在董事会专业委员会监督管理下，建立了由督察长、合规与风险控制委员会、法律合规部、风险管理部、相关职能部门和业务部门构成的立体式风险管理架构体系。

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基金管理人制定的银行可投资名单内的已进行充分内部研究的信用等级较高的商业银行，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，因此违约风险发生的可能性很小；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，信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过对单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，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

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

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	上年末 2023年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	183,702.79
未评级	-	-
合计	-	183,702.79

注：1、评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级债券为国债、政策性金融债、央行票据及无第三方机构评级的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人要求赎回的基金资产超出基金持有的现金类资产规模，另一方面来自于基金持有的投资品种交易不活跃而带来的变现困难或不能以合理的价格变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。于本报告期末，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。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中列示的部分基金资产流通暂时受限制外，其余均能及时变现。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。除本报告“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”章节中列示的卖出回购金融资产款余额将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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执行灵活的利率管理策略，借鉴瑞银全球资产管理公司海外管理经验，结合自主开发的估值系统管理利率风险，通过收益率利差分析、静态利差分析和期权调整利差等分析，计算组合证券的修正久期、利差久期、有效久期和有效凸性的风险控制指标，跟踪调整投资组合的久期和凸性等利率风险衡量指标，控制组合的利率风险。当预期债券市场利率下降时，加大固定利率证券的配置比例；当预期债券市场利率上升时，加大浮息证券的配置比例。通过改变浮息和固息证券的配置比例，控制证券投资基金的久期，防范利率风险。

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	69,562,973.74	-	-	-	69,562,973.74
结算备付金	17,568,263.98	-	-	-	17,568,263.98
存出保证金	171,317.67	-	-	-	171,317.67
交易性金融资产	-	-	-	1,208,758,873.92	1,208,758,873.92
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	118,768.36	118,768.36
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	639,232.54	639,232.54
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	35,030.84	35,030.84
资产总计	87,302,555.39	-	-	1,209,551,905.66	1,296,854,461.05
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	13,343.70	13,343.70
应付赎回款	-	-	-	407,350.81	407,350.81

应付管理人报酬	-	-	-	1,094,343.88	1,094,343.88
应付托管费	-	-	-	164,151.59	164,151.59
应付销售服务费	-	-	-	130,790.62	130,790.62
应交税费	-	-	-	0.32	0.32
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	2,561,692.49	2,561,692.49
负债总计	-	-	-	4,371,673.41	4,371,673.41
					1
利率敏感度缺口	87,302,555.39	-	-	1,205,180,232.25	1,292,482,787.64
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	81,251,623.96	-	-	-	81,251,623.96
结算备付金	16,824,774.66	-	-	-	16,824,774.66
存出保证金	416,756.53	-	-	-	416,756.53
交易性金融资产	-	183,580.79	122.00	1,340,421,028.21	1,340,604,731.00
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	877,616.95	877,616.95
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	29,280.40	29,280.40
资产总计	98,493,155.15	183,580.79	122.00	1,341,327,925.56	1,440,004,783.50
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	872,342.37	872,342.37
应付管理人报酬	-	-	-	1,205,259.89	1,205,259.89
应付托管费	-	-	-	180,788.99	180,788.99
应付销售服务费	-	-	-	156,968.12	156,968.12
应交税费	-	-	-	515.53	515.53

应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	3,785,627.35	3,785,627.35
负债总计	-	-	-	6,201,502.25	6,201,502.25
利率敏感度缺口	98,493,155.15	183,580.79	122.00	1,335,126,423.31	1,433,803,281.25

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 2024 年 6 月 30 日,本基金未持有交易性债券投资和交易性资产支持证券投资(上年末:0.01%),因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(上年末: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。

6.4.13.4.3 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证券,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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中,采用“自上而下”的策略,通过对宏观经济情况及政策的分析,结合证券市场运行情况,做出资产配置及组合构建的决定;通过对单个证券的定性分析及定量分析,选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化,对投资策略、资产配置、投资组合进行修正,通过投资组合的分散化等方式,来主动应对可能发生的其他价格风险。

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	1,208,758,873.92	93.52	1,340,421,028.21	93.49
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	183,702.79	0.01
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	1,208,758,873.92	93.52	1,340,604,731.00	93.50

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。下表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。		
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
	基金业绩比较基准增加 5%	62,686,811.08	66,522,027.98
	基金业绩比较基准减少 5%	-62,686,811.08	-66,522,027.98

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	1,207,805,019.26	1,331,465,364.05
第二层次	-	1,077,752.61
第三层次	953,854.66	8,061,614.34
合计	1,208,758,873.92	1,340,604,731.00

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于公开市场交易的证券，若出现重大事项、新发未上市等原因导致不存在活跃市场未经调整的报价，本基金不会于此期间将相关证券的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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	1,208,758,873.92	93.21
	其中：股票	1,208,758,873.92	93.21
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	87,131,237.72	6.72
8	其他各项资产	964,349.41	0.07
9	合计	1,296,854,461.05	100.00

注：1、本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

2、本基金不参与转融通证券出借业务。

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	5,299,507.00	0.41
B	采矿业	73,370,584.13	5.68
C	制造业	754,166,774.18	58.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	51,650,490.28	4.00
E	建筑业	16,148,460.16	1.25
F	批发和零售业	18,139,819.37	1.40
G	交通运输、仓储和邮政业	29,948,553.28	2.32
H	住宿和餐饮业	3,595,085.00	0.28
I	信息传输、软件和信息技术服务业	93,559,195.50	7.24
J	金融业	109,514,748.20	8.47
K	房地产业	20,292,812.50	1.57
L	租赁和商务服务业	4,741,504.12	0.37
M	科学研究和技术服务业	471,997.60	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	2,362,921.83	0.18
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	3,400,731.00	0.26
Q	卫生和社会工作	2,104,511.77	0.16
R	文化、体育和娱乐业	17,846,794.00	1.38
S	综合	2,144,384.00	0.17
	合计	1,208,758,873.92	93.52

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601058	赛轮轮胎	1,217,627.00	17,046,778.00	1.32
2	300207	欣旺达	1,005,900.00	15,259,503.00	1.18
3	000563	陕国投 A	5,543,000.00	15,243,250.00	1.18
4	000830	鲁西化工	1,274,000.00	14,765,660.00	1.14
5	300251	光线传媒	1,618,200.00	13,609,062.00	1.05
6	002152	广电运通	1,297,600.00	13,572,896.00	1.05
7	601717	郑煤机	907,400.00	13,429,520.00	1.04
8	002008	大族激光	641,100.00	13,334,880.00	1.03
9	300502	新易盛	122,100.00	12,887,655.00	1.00
10	688002	睿创微纳	450,813.00	12,609,239.61	0.98
11	601198	东兴证券	1,552,900.00	12,361,084.00	0.96
12	601991	大唐发电	4,035,400.00	12,146,554.00	0.94
13	600066	宇通客车	465,700.00	12,015,060.00	0.93
14	600549	厦门钨业	695,900.00	12,004,275.00	0.93
15	603160	汇顶科技	174,300.00	11,983,125.00	0.93
16	600642	申能股份	1,343,916.00	11,866,778.28	0.92
17	300383	光环新网	1,382,200.00	11,679,590.00	0.90
18	000703	恒逸石化	1,570,000.00	11,131,300.00	0.86
19	688777	中控技术	292,702.00	11,034,865.40	0.85
20	600582	天地科技	1,576,900.00	10,864,841.00	0.84
21	002745	木林森	1,344,700.00	10,838,282.00	0.84
22	002558	巨人网络	1,127,300.00	10,641,712.00	0.82
23	002340	格林美	1,670,500.00	10,641,085.00	0.82
24	688276	百克生物	363,930.00	10,324,694.10	0.80
25	000513	丽珠集团	276,800.00	10,299,728.00	0.80
26	601636	旗滨集团	1,574,700.00	10,156,815.00	0.79
27	000738	航发控制	494,300.00	9,920,601.00	0.77
28	603885	吉祥航空	900,000.00	9,891,000.00	0.77
29	000423	东阿阿胶	152,700.00	9,559,020.00	0.74
30	600711	盛屯矿业	2,574,800.00	9,449,516.00	0.73
31	002563	森马服饰	1,612,500.00	9,368,625.00	0.72
32	601555	东吴证券	1,584,200.00	9,346,780.00	0.72
33	000728	国元证券	1,537,430.00	9,316,825.80	0.72

34	600808	马钢股份	4,579,102.00	9,249,786.04	0.72
35	600004	白云机场	967,500.00	9,171,900.00	0.71
36	002128	电投能源	434,100.00	9,159,510.00	0.71
37	688819	天能股份	380,423.00	9,076,892.78	0.70
38	002078	太阳纸业	632,000.00	8,816,400.00	0.68
39	688516	奥特维	210,459.00	8,799,290.79	0.68
40	300724	捷佳伟创	154,149.00	8,325,587.49	0.64
41	000975	山金国际	508,600.00	8,285,094.00	0.64
42	603345	安井食品	108,800.00	8,084,928.00	0.63
43	600380	健康元	715,400.00	7,991,018.00	0.62
44	600143	金发科技	1,208,100.00	7,985,541.00	0.62
45	000027	深圳能源	1,088,160.00	7,943,568.00	0.61
46	002429	兆驰股份	1,645,000.00	7,912,450.00	0.61
47	600988	赤峰黄金	483,800.00	7,905,292.00	0.61
48	300146	汤臣倍健	568,108.00	7,697,863.40	0.60
49	002422	科伦药业	252,305.00	7,652,410.65	0.59
50	601168	西部矿业	424,400.00	7,617,980.00	0.59
51	600699	均胜电子	511,600.00	7,581,912.00	0.59
52	688188	柏楚电子	40,833.00	7,535,730.15	0.58
53	300394	天孚通信	84,700.00	7,489,174.00	0.58
54	002517	恺英网络	778,000.00	7,429,900.00	0.57
55	688234	天岳先进	156,137.00	7,325,948.04	0.57
56	688439	振华风光	106,433.00	7,072,472.85	0.55
57	600325	华发股份	1,084,025.00	7,046,162.50	0.55
58	600566	济川药业	213,300.00	6,763,743.00	0.52
59	002441	众业达	891,300.00	6,756,054.00	0.52
60	000567	海德股份	1,192,285.00	6,688,718.85	0.52
61	600970	中材国际	553,400.00	6,674,004.00	0.52
62	000050	深天马 A	916,000.00	6,668,480.00	0.52
63	002273	水晶光电	390,300.00	6,627,294.00	0.51
64	600967	内蒙一机	915,100.00	6,588,720.00	0.51
65	600707	彩虹股份	961,100.00	6,545,091.00	0.51
66	688772	珠海冠宇	436,998.00	6,511,270.20	0.50
67	601916	浙商银行	2,353,900.00	6,496,764.00	0.50
68	600737	中粮糖业	675,200.00	6,475,168.00	0.50
69	688036	传音控股	84,351.00	6,456,225.54	0.50
70	002025	航天电器	138,100.00	6,405,078.00	0.50
71	603379	三美股份	159,100.00	6,227,174.00	0.48
72	002683	广东宏大	302,700.00	6,093,351.00	0.47
73	000921	海信家电	181,500.00	5,851,560.00	0.45
74	002065	东华软件	1,277,200.00	5,772,944.00	0.45
75	002138	顺络电子	203,600.00	5,590,856.00	0.43
76	002738	中矿资源	203,872.00	5,463,769.60	0.42

77	001227	兰州银行	2,262,000.00	5,383,560.00	0.42
78	600399	抚顺特钢	947,800.00	5,336,114.00	0.41
79	688029	南微医学	86,664.00	5,335,035.84	0.41
80	600598	北大荒	424,300.00	5,299,507.00	0.41
81	000997	新大陆	374,200.00	5,205,122.00	0.40
82	600901	江苏金租	1,016,111.00	5,131,360.55	0.40
83	000009	中国宝安	586,300.00	5,042,180.00	0.39
84	600529	山东药玻	197,000.00	4,991,980.00	0.39
85	600521	华海药业	290,100.00	4,946,205.00	0.38
86	688525	佰维存储	76,443.00	4,903,818.45	0.38
87	600282	南钢股份	979,100.00	4,875,918.00	0.38
88	600157	永泰能源	4,008,800.00	4,730,384.00	0.37
89	601000	唐山港	989,700.00	4,651,590.00	0.36
90	002249	大洋电机	962,400.00	4,552,152.00	0.35
91	000598	兴蓉环境	591,500.00	4,448,080.00	0.34
92	600315	上海家化	249,500.00	4,436,110.00	0.34
93	600497	驰宏锌锗	815,200.00	4,353,168.00	0.34
94	300390	天华新能	253,200.00	4,349,976.00	0.34
95	002028	思源电气	64,720.00	4,329,768.00	0.33
96	688208	道通科技	179,273.00	4,327,650.22	0.33
97	688169	石头科技	10,824.00	4,249,502.40	0.33
98	600535	天士力	335,600.00	4,221,848.00	0.33
99	002215	诺普信	565,100.00	4,209,995.00	0.33
100	601601	中国太保	150,300.00	4,187,358.00	0.32
101	688099	晶晨股份	70,420.00	4,177,314.40	0.32
102	300595	欧普康视	264,100.00	4,141,088.00	0.32
103	600339	中油工程	1,320,800.00	4,120,896.00	0.32
104	300009	安科生物	472,045.00	4,031,264.30	0.31
105	300017	网宿科技	506,100.00	3,998,190.00	0.31
106	000887	中鼎股份	318,600.00	3,899,664.00	0.30
107	600517	国网英大	898,300.00	3,889,639.00	0.30
108	002223	鱼跃医疗	101,600.00	3,820,160.00	0.30
109	600863	内蒙华电	816,400.00	3,788,096.00	0.29
110	600859	王府井	319,300.00	3,748,582.00	0.29
111	601106	中国一重	1,608,900.00	3,716,559.00	0.29
112	300253	卫宁健康	628,600.00	3,708,740.00	0.29
113	600959	江苏有线	1,395,400.00	3,683,856.00	0.29
114	600848	上海临港	402,600.00	3,667,686.00	0.28
115	000636	风华高科	279,700.00	3,652,882.00	0.28
116	688220	翱捷科技	96,643.00	3,620,246.78	0.28
117	300144	宋城演艺	450,500.00	3,617,515.00	0.28
118	600258	首旅酒店	291,100.00	3,595,085.00	0.28
119	688385	复旦微电	113,864.00	3,573,052.32	0.28

120	600329	达仁堂	109,000.00	3,530,510.00	0.27
121	603456	九洲药业	255,700.00	3,508,204.00	0.27
122	600583	海油工程	591,600.00	3,496,356.00	0.27
123	600015	华夏银行	535,300.00	3,425,920.00	0.27
124	002607	中公教育	2,222,700.00	3,400,731.00	0.26
125	000825	太钢不锈	989,400.00	3,344,172.00	0.26
126	000039	中集集团	358,600.00	3,320,636.00	0.26
127	002203	海亮股份	415,300.00	3,314,094.00	0.26
128	601231	环旭电子	203,500.00	3,266,175.00	0.25
129	300558	贝达药业	99,600.00	3,241,980.00	0.25
130	002465	海格通信	309,000.00	3,201,240.00	0.25
131	000967	盈峰环境	751,600.00	3,179,268.00	0.25
132	600862	中航高科	168,100.00	3,156,918.00	0.24
133	300866	安克创新	44,190.00	3,146,769.90	0.24
134	688006	杭可科技	176,650.00	3,082,542.50	0.24
135	603317	天味食品	268,040.00	3,058,336.40	0.24
136	601990	南京证券	397,000.00	3,048,960.00	0.24
137	688063	派能科技	75,957.00	3,016,252.47	0.23
138	601666	平煤股份	266,300.00	2,982,560.00	0.23
139	688599	天合光能	175,278.00	2,965,703.76	0.23
140	601077	渝农商行	587,700.00	2,950,254.00	0.23
141	600938	中国海油	87,800.00	2,897,400.00	0.22
142	601568	北元集团	777,970.00	2,886,268.70	0.22
143	002384	东山精密	139,400.00	2,885,580.00	0.22
144	688510	航亚科技	154,705.00	2,848,119.05	0.22
145	600839	四川长虹	624,000.00	2,801,760.00	0.22
146	603077	和邦生物	1,690,300.00	2,788,995.00	0.22
147	600510	黑牡丹	734,400.00	2,731,968.00	0.21
148	300601	康泰生物	174,100.00	2,717,701.00	0.21
149	688349	三一重能	108,646.00	2,698,766.64	0.21
150	300001	特锐德	132,700.00	2,669,924.00	0.21
151	300212	易华录	157,700.00	2,654,091.00	0.21
152	603939	益丰药房	108,020.00	2,651,891.00	0.21
153	688728	格科微	214,446.00	2,596,941.06	0.20
154	002850	科达利	32,900.00	2,512,902.00	0.19
155	002436	兴森科技	241,600.00	2,493,312.00	0.19
156	603589	口子窖	63,000.00	2,468,970.00	0.19
157	688567	孚能科技	254,676.00	2,444,889.60	0.19
158	002602	世纪华通	708,800.00	2,431,184.00	0.19
159	688375	国博电子	34,376.00	2,428,320.64	0.19
160	600663	陆家嘴	271,900.00	2,398,158.00	0.19
161	601577	长沙银行	291,500.00	2,384,470.00	0.18
162	002153	石基信息	412,700.00	2,364,771.00	0.18

163	002155	湖南黄金	129,800.00	2,349,380.00	0.18
164	002625	光启技术	133,800.00	2,321,430.00	0.18
165	603568	伟明环保	112,320.00	2,311,545.60	0.18
166	601608	中信重工	601,700.00	2,292,477.00	0.18
167	300677	英科医疗	84,700.00	2,270,807.00	0.18
168	600025	华能水电	209,200.00	2,255,176.00	0.17
169	600000	浦发银行	269,400.00	2,217,162.00	0.17
170	002831	裕同科技	85,620.00	2,191,015.80	0.17
171	600377	宁沪高速	173,100.00	2,181,060.00	0.17
172	301236	软通动力	61,200.00	2,154,852.00	0.17
173	600673	东阳光	304,600.00	2,144,384.00	0.17
174	600909	华安证券	498,900.00	2,100,369.00	0.16
175	688798	艾为电子	37,037.00	2,097,034.94	0.16
176	688778	厦钨新能	67,117.00	2,096,735.08	0.16
177	603882	金域医学	76,800.00	2,088,192.00	0.16
178	603883	老百姓	112,910.00	2,073,027.60	0.16
179	688348	昱能科技	34,387.00	2,028,833.00	0.16
180	688390	固德威	35,658.00	2,001,126.96	0.15
181	600415	小商品城	267,600.00	1,985,592.00	0.15
182	688287	观典防务	376,870.00	1,982,336.20	0.15
183	688690	纳微科技	113,319.00	1,968,351.03	0.15
184	002608	江苏国信	253,200.00	1,962,300.00	0.15
185	600418	江淮汽车	122,000.00	1,932,480.00	0.15
186	002056	横店东磁	154,400.00	1,925,368.00	0.15
187	600871	石化油服	1,081,700.00	1,882,158.00	0.15
188	000933	神火股份	92,200.00	1,865,206.00	0.14
189	001872	招商港口	96,300.00	1,853,775.00	0.14
190	002303	美盈森	769,000.00	1,853,290.00	0.14
191	001914	招商积余	184,200.00	1,845,684.00	0.14
192	603225	新凤鸣	118,100.00	1,841,179.00	0.14
193	002444	巨星科技	73,300.00	1,810,510.00	0.14
194	603688	石英股份	60,500.00	1,791,405.00	0.14
195	300857	协创数据	31,400.00	1,789,800.00	0.14
196	002048	宁波华翔	137,600.00	1,780,544.00	0.14
197	601108	财通证券	269,300.00	1,780,073.00	0.14
198	603596	伯特利	45,560.00	1,772,284.00	0.14
199	600872	中炬高新	77,300.00	1,753,937.00	0.14
200	688281	华秦科技	21,015.00	1,750,969.80	0.14
201	688232	新点软件	87,226.00	1,720,096.72	0.13
202	002240	盛新锂能	127,700.00	1,713,734.00	0.13
203	601156	东航物流	83,800.00	1,705,330.00	0.13
204	002185	华天科技	204,800.00	1,669,120.00	0.13
205	688331	荣昌生物	38,429.00	1,660,132.80	0.13

206	601838	成都银行	108,000.00	1,640,520.00	0.13
207	601398	工商银行	285,300.00	1,626,210.00	0.13
208	688278	特宝生物	30,057.00	1,609,552.35	0.12
209	002653	海思科	52,200.00	1,602,540.00	0.12
210	688388	嘉元科技	164,212.00	1,601,067.00	0.12
211	600060	海信视像	64,400.00	1,593,256.00	0.12
212	603517	绝味食品	103,100.00	1,587,740.00	0.12
213	600968	海油发展	380,000.00	1,565,600.00	0.12
214	600348	华阳股份	156,800.00	1,561,728.00	0.12
215	688779	长远锂科	335,101.00	1,551,517.63	0.12
216	000937	冀中能源	228,600.00	1,531,620.00	0.12
217	300529	健帆生物	56,100.00	1,526,481.00	0.12
218	600820	隧道股份	232,900.00	1,520,837.00	0.12
219	600039	四川路桥	192,600.00	1,519,614.00	0.12
220	300841	康华生物	29,000.00	1,468,560.00	0.11
221	603185	弘元绿能	85,300.00	1,457,777.00	0.11
222	000155	川能动力	133,000.00	1,432,410.00	0.11
223	600718	东软集团	169,500.00	1,401,765.00	0.11
224	601512	中新集团	183,300.00	1,396,746.00	0.11
225	300122	智飞生物	49,800.00	1,395,894.00	0.11
226	601958	金铂股份	128,793.00	1,340,735.13	0.10
227	688252	天德钰	91,712.00	1,332,575.36	0.10
228	300373	扬杰科技	33,700.00	1,310,930.00	0.10
229	600989	宝丰能源	74,800.00	1,296,284.00	0.10
230	300699	光威复材	52,200.00	1,296,126.00	0.10
231	002372	伟星新材	83,464.00	1,287,014.88	0.10
232	601233	桐昆股份	80,600.00	1,286,376.00	0.10
233	603529	爱玛科技	46,800.00	1,279,044.00	0.10
234	600827	百联股份	171,400.00	1,264,932.00	0.10
235	002984	森麒麟	52,200.00	1,257,498.00	0.10
236	600096	云天化	64,200.00	1,246,764.00	0.10
237	002032	苏泊尔	24,800.00	1,242,480.00	0.10
238	002019	亿帆医药	100,500.00	1,242,180.00	0.10
239	601888	中国中免	19,600.00	1,224,804.00	0.09
240	600885	宏发股份	44,000.00	1,217,920.00	0.09
241	600773	西藏城投	116,900.00	1,206,408.00	0.09
242	603233	大参林	79,800.00	1,141,140.00	0.09
243	300136	信维通信	57,700.00	1,129,766.00	0.09
244	300439	美康生物	122,700.00	1,123,932.00	0.09
245	600219	南山铝业	294,700.00	1,122,807.00	0.09
246	000408	藏格矿业	46,400.00	1,116,848.00	0.09
247	600900	长江电力	36,500.00	1,055,580.00	0.08
248	600765	中航重机	51,700.00	1,054,680.00	0.08

249	300861	美畅股份	54,400.00	1,052,640.00	0.08
250	601966	玲珑轮胎	57,200.00	1,050,764.00	0.08
251	601009	南京银行	101,100.00	1,050,429.00	0.08
252	600160	巨化股份	43,400.00	1,047,242.00	0.08
253	300418	昆仑万维	32,200.00	1,038,128.00	0.08
254	002414	高德红外	172,200.00	1,014,258.00	0.08
255	600133	东湖高新	96,600.00	1,008,504.00	0.08
256	688371	菲沃泰	98,270.00	986,630.80	0.08
257	002782	可立克	88,400.00	979,472.00	0.08
258	601877	正泰电器	50,700.00	966,342.00	0.07
259	002945	华林证券	95,100.00	949,098.00	0.07
260	000032	深桑达 A	60,300.00	903,294.00	0.07
261	002497	雅化集团	100,800.00	899,136.00	0.07
262	601169	北京银行	152,000.00	887,680.00	0.07
263	002508	老板电器	40,100.00	886,210.00	0.07
264	605166	聚合顺	84,300.00	884,307.00	0.07
265	002261	拓维信息	79,600.00	881,172.00	0.07
266	688017	绿的谐波	10,467.00	859,340.70	0.07
267	002648	卫星化学	45,400.00	816,292.00	0.06
268	002966	苏州银行	106,500.00	798,750.00	0.06
269	000818	航锦科技	35,100.00	775,008.00	0.06
270	002737	葵花药业	31,700.00	741,146.00	0.06
271	300280	紫天科技	46,800.00	713,232.00	0.06
272	688180	君实生物	24,453.00	710,359.65	0.05
273	688327	云从科技	61,212.00	692,307.72	0.05
274	002939	长城证券	100,000.00	670,000.00	0.05
275	300850	新强联	43,000.00	645,860.00	0.05
276	000630	铜陵有色	178,000.00	642,580.00	0.05
277	601865	福莱特	31,700.00	637,170.00	0.05
278	688311	盟升电子	31,015.00	635,497.35	0.05
279	002161	远望谷	136,600.00	631,092.00	0.05
280	002739	万达电影	51,300.00	620,217.00	0.05
281	600177	雅戈尔	86,100.00	613,032.00	0.05
282	688297	中无人机	18,493.00	610,823.79	0.05
283	300037	新宙邦	20,800.00	594,048.00	0.05
284	600416	湘电股份	58,900.00	585,466.00	0.05
285	300134	大富科技	85,400.00	582,428.00	0.05
286	002463	沪电股份	15,700.00	573,050.00	0.04
287	002068	黑猫股份	79,800.00	566,580.00	0.04
288	300054	鼎龙股份	24,600.00	557,928.00	0.04
289	603338	浙江鼎力	9,100.00	549,822.00	0.04
290	300568	星源材质	67,000.00	549,400.00	0.04
291	002756	永兴材料	15,300.00	547,434.00	0.04

292	603712	七一二	29,300.00	532,967.00	0.04
293	300438	鹏辉能源	29,000.00	531,860.00	0.04
294	688717	艾罗能源	11,303.00	531,467.06	0.04
295	002291	遥望科技	121,800.00	523,740.00	0.04
296	300073	当升科技	14,400.00	494,064.00	0.04
297	603055	台华新材	48,700.00	493,331.00	0.04
298	601311	骆驼股份	61,200.00	490,824.00	0.04
299	300114	中航电测	10,800.00	488,700.00	0.04
300	600105	永鼎股份	129,800.00	482,856.00	0.04
301	601298	青岛港	50,400.00	481,824.00	0.04
302	000999	华润三九	11,310.00	481,579.80	0.04
303	300765	新诺威	18,700.00	471,801.00	0.04
304	603606	东方电缆	9,300.00	453,933.00	0.04
305	301358	湖南裕能	14,400.00	453,024.00	0.04
306	601828	美凯龙	174,700.00	445,485.00	0.03
307	600050	中国联通	94,600.00	444,620.00	0.03
308	002518	科士达	24,800.00	438,960.00	0.03
309	002507	涪陵榨菜	35,100.00	429,975.00	0.03
310	600062	华润双鹤	21,900.00	428,802.00	0.03
311	002595	豪迈科技	11,200.00	427,504.00	0.03
312	000712	锦龙股份	57,000.00	427,500.00	0.03
313	688598	金博股份	14,887.00	421,302.10	0.03
314	300012	华测检测	41,800.00	420,508.00	0.03
315	300005	探路者	83,100.00	416,331.00	0.03
316	688177	百奥泰	19,153.00	404,511.36	0.03
317	600704	物产中大	93,100.00	404,054.00	0.03
318	601117	中国化学	47,600.00	392,224.00	0.03
319	688260	昀冢科技	26,337.00	391,631.19	0.03
320	603156	养元饮品	18,000.00	382,860.00	0.03
321	002318	久立特材	16,400.00	382,612.00	0.03
322	002354	天娱数科	126,800.00	379,132.00	0.03
323	300081	恒信东方	85,200.00	376,584.00	0.03
324	601162	天风证券	170,100.00	370,818.00	0.03
325	600755	厦门国贸	51,600.00	369,972.00	0.03
326	301589	诺瓦星云	1,244.00	233,884.44	0.02
327	688249	晶合集成	7,188.00	105,447.96	0.01
328	000783	长江证券	20,500.00	99,015.00	0.01
329	300674	宇信科技	8,000.00	88,640.00	0.01
330	301499	维科精密	3,609.00	82,032.57	0.01
331	300679	电连技术	2,000.00	80,460.00	0.01
332	688472	阿特斯	6,122.00	62,321.96	0.00
333	688563	航材股份	1,143.00	60,441.84	0.00
334	002277	友阿股份	25,600.00	55,296.00	0.00

335	688469	芯联集成	13,196.00	52,256.16	0.00
336	300931	通用电梯	8,900.00	48,772.00	0.00
337	603107	上海汽配	2,920.00	46,398.80	0.00
338	603296	华勤技术	830.00	45,840.90	0.00
339	002836	新宏泽	7,700.00	45,199.00	0.00
340	300069	金利华电	3,700.00	40,700.00	0.00
341	688484	南芯科技	1,008.00	37,396.80	0.00
342	688548	广钢气体	4,048.00	36,958.24	0.00
343	001326	联域股份	986.00	35,357.96	0.00
344	301526	国际复材	9,723.00	32,377.59	0.00
345	002371	北方华创	100.00	31,989.00	0.00
346	688146	中船特气	1,011.00	30,178.35	0.00
347	301498	乖宝宠物	554.00	29,805.20	0.00
348	600612	老凤祥	500.00	29,095.00	0.00
349	688549	中巨芯	4,294.00	28,984.50	0.00
350	000568	泸州老窖	200.00	28,698.00	0.00
351	600702	舍得酒业	500.00	28,335.00	0.00
352	688352	顾中科技	2,361.00	26,939.01	0.00
353	301027	华蓝集团	2,800.00	24,752.00	0.00
354	000623	吉林敖东	1,800.00	24,120.00	0.00
355	688531	日联科技	502.00	23,172.32	0.00
356	001287	中电港	1,386.00	22,910.58	0.00
357	301487	盟固利	867.00	22,420.62	0.00
358	688702	盛科通信	549.00	22,234.50	0.00
359	600795	国电电力	3,600.00	21,564.00	0.00
360	300710	万隆光电	1,400.00	21,238.00	0.00
361	688631	莱斯信息	336.00	20,838.72	0.00
362	301511	德福科技	1,375.00	20,295.00	0.00
363	601033	永兴股份	1,258.00	20,077.68	0.00
364	688709	成都华微	1,045.00	19,635.55	0.00
365	301559	中集环科	1,315.00	19,159.55	0.00
366	688629	华丰科技	708.00	18,662.88	0.00
367	301348	蓝箭电子	613.00	18,629.07	0.00
368	301325	曼恩斯特	437.00	18,537.54	0.00
369	688582	芯动联科	648.00	18,247.68	0.00
370	688570	天玛智控	884.00	18,024.76	0.00
371	301383	天键股份	690.00	18,022.80	0.00
372	300920	润阳科技	1,100.00	16,544.00	0.00
373	301293	三博脑科	433.00	16,319.77	0.00
374	688652	京仪装备	416.00	16,261.44	0.00
375	601096	宏盛华源	3,918.00	16,024.62	0.00
376	688507	索辰科技	324.00	15,746.40	0.00
377	301262	海看股份	692.00	15,604.60	0.00

378	301536	星辰科技	481.00	15,521.87	0.00
379	688552	航天南湖	956.00	15,487.20	0.00
380	301525	儒竞科技	266.00	14,970.48	0.00
381	301345	涛涛车业	266.00	14,656.60	0.00
382	301421	波长光电	332.00	14,352.36	0.00
383	301362	民爆光电	420.00	14,305.20	0.00
384	688334	西高院	888.00	14,296.80	0.00
385	301468	博盈特焊	598.00	13,831.74	0.00
386	688584	上海合晶	866.00	13,760.74	0.00
387	301538	骏鼎达	150.00	13,686.00	0.00
388	301509	金凯生科	372.00	13,533.36	0.00
389	301307	美利信	687.00	13,451.46	0.00
390	301172	君逸数码	438.00	12,868.44	0.00
391	301246	宏源药业	931.00	12,531.26	0.00
392	301550	斯菱股份	260.00	12,456.60	0.00
393	301558	三态股份	1,458.00	12,232.62	0.00
394	601083	锦江航运	1,263.00	12,074.28	0.00
395	301439	泓淋电力	949.00	12,023.83	0.00
396	301141	中科磁业	367.00	11,835.75	0.00
397	301305	朗坤环境	753.00	11,453.13	0.00
398	301397	溯联股份	362.00	11,366.80	0.00
399	301516	中远通	604.00	11,252.52	0.00
400	688612	威迈斯	422.00	11,212.54	0.00
401	603341	龙旗科技	298.00	11,172.02	0.00
402	688581	安杰思	228.00	11,156.04	0.00
403	688562	航天软件	726.00	11,086.02	0.00
404	301251	威尔高	321.00	11,052.03	0.00
405	301393	昊帆生物	260.00	11,042.20	0.00
406	301510	固高科技	396.00	10,989.00	0.00
407	301507	民生健康	851.00	10,739.62	0.00
408	301456	盘古智能	407.00	10,618.63	0.00
409	688691	灿芯股份	247.00	10,499.97	0.00
410	301548	崇德科技	197.00	10,456.76	0.00
411	688627	精智达	222.00	10,305.24	0.00
412	301322	绿通科技	549.00	10,304.73	0.00
413	688623	二元科技	178.00	10,008.94	0.00
414	301517	陕西华达	185.00	9,990.00	0.00
415	301332	德尔玛	1,122.00	9,918.48	0.00
416	301566	达利凯普	576.00	9,774.72	0.00
417	688593	新相微	959.00	9,590.00	0.00
418	301382	蜂助手	530.00	9,587.70	0.00
419	301225	恒勃股份	333.00	9,457.20	0.00
420	688610	埃科光电	275.00	9,248.25	0.00

421	301489	思泉新材	128.00	9,034.24	0.00
422	688592	司南导航	216.00	8,894.88	0.00
423	301376	致欧科技	420.00	8,891.40	0.00
424	301329	信音电子	458.00	8,853.14	0.00
425	301413	安培龙	213.00	8,807.55	0.00
426	688433	华曙高科	418.00	8,719.48	0.00
427	688653	康希通信	648.00	8,346.24	0.00
428	688458	美芯晟	309.00	8,281.20	0.00
429	688620	安凯微	1,016.00	8,270.24	0.00
430	301459	丰茂股份	208.00	8,259.68	0.00
431	688602	康鹏科技	1,066.00	8,176.22	0.00
432	301591	肯特股份	219.00	8,098.62	0.00
433	301500	飞南资源	455.00	7,939.75	0.00
434	603135	中重科技	628.00	7,868.84	0.00
435	301386	未来电器	378.00	7,839.72	0.00
436	301568	思泰克	246.00	7,827.72	0.00
437	301395	仁信新材	728.00	7,775.04	0.00
438	301587	中瑞股份	306.00	7,729.56	0.00
439	001389	广合科技	222.00	7,672.32	0.00
440	301429	森泰股份	499.00	7,634.70	0.00
441	601065	江盐集团	875.00	7,586.25	0.00
442	301281	科源制药	337.00	7,565.65	0.00
443	301418	协昌科技	189.00	7,560.00	0.00
444	301315	威士顿	226.00	7,365.34	0.00
445	301261	恒工精密	198.00	7,339.86	0.00
446	301519	舜禹股份	442.00	7,319.52	0.00
447	688603	天承科技	140.00	7,309.40	0.00
448	301292	海科新源	583.00	7,211.71	0.00
449	301323	新莱福	228.00	7,200.24	0.00
450	301539	宏鑫科技	361.00	7,155.02	0.00
451	601133	柏诚股份	664.00	7,098.16	0.00
452	688719	爱科赛博	272.00	7,091.04	0.00
453	688646	逸飞激光	219.00	6,834.99	0.00
454	301469	恒达新材	275.00	6,712.75	0.00
455	688720	艾森股份	165.00	6,689.10	0.00
456	301272	英华特	173.00	6,674.34	0.00
457	301518	长华化学	385.00	6,672.05	0.00
458	301520	万邦医药	160.00	6,620.80	0.00
459	688648	中邮科技	303.00	6,617.52	0.00
460	301428	世纪恒通	229.00	6,572.30	0.00
461	301170	锡南科技	250.00	6,512.50	0.00
462	301337	亚华电子	232.00	6,398.56	0.00
463	688693	锆威特	178.00	6,393.76	0.00

464	301203	国泰环保	225.00	6,369.75	0.00
465	301555	惠柏新材	224.00	6,345.92	0.00
466	301528	多浦乐	148.00	6,340.32	0.00
467	301372	科净源	231.00	6,156.15	0.00
468	688638	誉辰智能	197.00	6,148.37	0.00
469	688512	慧智微	721.00	6,121.29	0.00
470	688573	信宇人	285.00	6,093.30	0.00
471	301578	辰奕智能	153.00	6,054.21	0.00
472	301295	美硕科技	301.00	5,992.91	0.00
473	301529	福赛科技	182.00	5,971.42	0.00
474	688695	中创股份	186.00	5,868.30	0.00
475	688429	时创能源	346.00	5,861.24	0.00
476	301505	苏州规划	194.00	5,820.00	0.00
477	301360	荣旗科技	134.00	5,795.50	0.00
478	603275	众辰科技	193.00	5,790.00	0.00
479	301533	威马农机	225.00	5,780.25	0.00
480	688716	中研股份	267.00	5,660.40	0.00
481	603193	润本股份	303.00	5,572.17	0.00
482	301588	美新科技	257.00	5,461.25	0.00
483	688657	浩辰软件	147.00	5,433.12	0.00
484	301355	南王科技	563.00	5,399.17	0.00
485	688479	友车科技	332.00	5,275.48	0.00
486	301502	华阳智能	138.00	5,220.54	0.00
487	603119	浙江荣泰	294.00	5,209.68	0.00
488	688651	盛邦安全	178.00	5,206.50	0.00
489	300804	广康生化	226.00	4,926.80	0.00
490	001378	德冠新材	205.00	4,891.30	0.00
491	301157	华塑科技	150.00	4,890.00	0.00
492	001380	华纬科技	241.00	4,685.04	0.00
493	603325	博隆技术	66.00	4,491.96	0.00
494	301515	港通医疗	230.00	4,402.20	0.00
495	603344	星德胜	182.00	4,124.12	0.00
496	688450	光格科技	167.00	4,064.78	0.00
497	603125	常青科技	232.00	3,992.72	0.00
498	603270	金帝股份	195.00	3,868.80	0.00
499	001359	平安电工	184.00	3,790.40	0.00
500	001328	登康口腔	145.00	3,668.50	0.00
501	001306	夏厦精密	64.00	3,455.36	0.00
502	603312	西典新能	130.00	3,296.80	0.00
503	603273	天元智能	178.00	3,266.30	0.00
504	603075	热威股份	182.00	3,212.30	0.00
505	603082	北自科技	107.00	3,155.43	0.00
506	001379	腾达科技	213.00	2,871.24	0.00

507	603375	盛景微	72.00	2,800.80	0.00
508	603231	索宝蛋白	161.00	2,743.44	0.00
509	001387	雪祺电气	173.00	2,638.25	0.00
510	001239	永达股份	189.00	2,623.32	0.00
511	001358	兴欣新材	122.00	2,503.44	0.00
512	603276	恒兴新材	174.00	2,425.56	0.00
513	603373	安邦护卫	88.00	2,419.12	0.00
514	001360	南矿集团	177.00	2,175.33	0.00
515	603137	恒尚节能	195.00	1,989.00	0.00
516	603172	万丰股份	122.00	1,971.52	0.00
517	001367	海森药业	81.00	1,890.54	0.00
518	001324	长青科技	114.00	1,846.80	0.00
519	301408	华人健康	79.00	808.17	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	002422	科伦药业	23,638,126.40	1.65
2	300251	光线传媒	20,988,112.69	1.46
3	002558	巨人网络	18,984,727.82	1.32
4	688772	珠海冠宇	18,236,066.52	1.27
5	600901	江苏金租	17,899,509.66	1.25
6	601108	财通证券	17,584,142.00	1.23
7	000563	陕国投 A	16,158,590.00	1.13
8	688276	百克生物	15,997,476.17	1.12
9	300207	欣旺达	15,806,504.00	1.10
10	002152	广电运通	15,622,139.00	1.09
11	000830	鲁西化工	15,527,908.00	1.08
12	601318	中国平安	15,499,490.00	1.08
13	600745	闻泰科技	15,454,426.90	1.08
14	601717	郑煤机	14,839,986.00	1.04
15	300682	朗新集团	14,789,898.00	1.03
16	002555	三七互娱	14,648,515.00	1.02
17	603456	九洲药业	14,166,111.00	0.99
18	601198	东兴证券	14,107,357.50	0.98
19	300383	光环新网	13,870,631.00	0.97
20	688439	振华风光	13,868,847.80	0.97

注：“买入金额”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	002422	科伦药业	36,733,788.29	2.56
2	603589	口子窖	25,208,217.02	1.76
3	601233	桐昆股份	21,837,368.48	1.52
4	000960	锡业股份	21,809,577.00	1.52
5	601958	金钼股份	20,600,513.00	1.44
6	600637	东方明珠	20,481,861.99	1.43
7	600968	海油发展	20,221,380.00	1.41
8	603228	景旺电子	19,325,054.70	1.35
9	600497	驰宏锌锗	18,237,302.00	1.27
10	300118	东方日升	18,219,455.57	1.27
11	600642	申能股份	18,100,095.00	1.26
12	000591	太阳能	17,691,643.00	1.23
13	002939	长城证券	17,439,644.00	1.22
14	000089	深圳机场	17,216,349.10	1.20
15	600707	彩虹股份	17,003,190.00	1.19
16	002625	光启技术	16,919,669.93	1.18
17	600529	山东药玻	16,528,970.00	1.15
18	603225	新凤鸣	16,413,723.20	1.14
19	601318	中国平安	16,231,375.00	1.13
20	002739	万达电影	16,220,753.00	1.13

注：“卖出金额”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

买入股票的成本（成交）总额	2,220,032,429.41
卖出股票的收入（成交）总额	2,288,925,859.99

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

为更好地实现投资目标，本基金在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，适度运用股指期货。本基金利用股指期货流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，提高投资组合的运作效率。

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，同时兼顾基差的变化，以达到有效跟踪标的指数的目的。本报告期内，本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目标。

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

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

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中，陕西省国际信托股份有限公司在报告编制前一年受到国家金融监督管理总局陕西监管局的处罚。本基金对上述证券的投资决策程序符合相关法规及公司制度的要求。基金管理人认为，上述事件有利于上述公司加强内部管理，上述公司当前总体生产经营和财务状况保持稳定，事件对上述公司经营活动未产生实质性影响，不改变上述公司基本面。除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券发行主体存在本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选库的情况。

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	171,317.67
2	应收清算款	118,768.36
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	639,232.54
6	其他应收款	35,030.84
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	964,349.41

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

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
国投瑞银中证 500 指数量化增强 A	158,630	3,218.41	27,896,294.30	5.46%	482,639,801.59	94.54%

国投瑞银中证 500 指数量化增强 C	23,206	9,554.88	148,530,664.19	66.99%	73,199,930.16	33.01%
合计	181,836	4,027.07	176,426,958.49	24.09%	555,839,731.75	75.91%

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（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	国投瑞银中证 500 指数量化增强 A	789,726.78	0.15%
	国投瑞银中证 500 指数量化增强 C	180,140.68	0.08%
	合计	969,867.46	0.13%

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的情况

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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	国投瑞银中证 500 指数量化增强 A	10~50
	国投瑞银中证 500 指数量化增强 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	国投瑞银中证 500 指数量化增强 A	10~50
	国投瑞银中证 500 指数量化增强 C	0
	合计	10~50

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国投瑞银中证 500 指数量化增强 A	国投瑞银中证 500 指数量化增强 C
基金合同生效日（2018 年 8 月 1 日）基金份额总额	612,977,736.48	-
本报告期期初基金份额总额	521,589,269.51	256,257,502.26
本报告期基金总申购份额	48,885,583.35	17,168,564.80
减：本报告期基金总赎回份额	59,938,756.97	51,695,472.71
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	510,536,095.89	221,730,594.35

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

报告期内，基金管理人无重大人事变动。

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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，涉及基金管理人的诉讼事项如下：

2023 年 11 月，基金管理人子公司国投瑞银资本管理有限公司（以下称“国投瑞银资本”）旗下某专项资产管理计划的投资人之一向北京市西城区人民法院提起诉讼，要求国投瑞银资本及该专项资产管理计划的投资顾问连带赔偿投资本金及利息损失；报告期内，该投资人将基金管理人追加为共同被告，案件已于 2024 年 6 月份开庭审理，尚待法院出具判决书。

上述未决事项不会对基金管理人公司生产经营、财务状况造成重大不利影响。

除上述事项外，本报告期内无其他涉及基金管理人、基金财产的诉讼事项。

报告期内无涉及本基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未发生改聘会计师事务所的情况。

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

报告期内基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人及其相关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	佣金	占当期佣金总量的	

			额的比例		比例	
中信证券	1	929,615,485.61	20.62%	879,315.50	20.62%	-
国泰君安	1	595,196,491.78	13.20%	563,002.89	13.21%	-
德邦证券	1	592,166,551.90	13.14%	560,142.34	13.14%	-
瑞银证券	1	546,776,915.75	12.13%	517,202.56	12.13%	-
长江证券	1	542,998,755.05	12.05%	513,612.03	12.05%	-
中信建投证券	2	538,848,130.93	11.95%	509,697.13	11.95%	-
东北证券	1	246,024,056.99	5.46%	232,715.45	5.46%	-
申万宏源证券	1	194,854,185.69	4.32%	184,309.72	4.32%	-
信达证券	1	151,532,012.76	3.36%	143,334.88	3.36%	-
招商证券	1	91,865,303.60	2.04%	86,895.77	2.04%	-
平安证券	1	77,515,774.60	1.72%	73,321.81	1.72%	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
国新证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本基金管理人在租用证券机构交易单元上符合中国证监会的有关规定。本基金管理人将证券经营机构的注册资本、研究水平、财务状况、经营状况、经营行为以及通讯交易条件作为基金专用交易单元的选择标准，由研究部、投资部及交易部对券商进行考评并提出交易单元租用及更换方案。根据董事会授权，由公司执行委员会批准。

2、本基金本报告期租用证券公司交易单元未发生变更。

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		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期回购成交总额的 比例	成交金额	占当期权证成交总额的 比例
中信证券	349,588.16	98.77%	-	-	-	-
德邦证券	4,355.23	1.23%	-	-	-	-

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	国投瑞银基金管理有限公司关于提醒投资者	上海证券报，证券时报，	2024-05-24

	及时提供或更新身份信息及投资者适当性信息的公告	中国证券报，证券日报，中国证监会基金电子披露网站	
--	-------------------------	--------------------------	--

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

产品特有风险
<p>投资者应关注本基金单一投资者持有份额比例过高时，可能出现以下风险：</p> <p>1、赎回申请延期办理的风险 单一投资者大额赎回时易触发本基金巨额赎回的条件，中小投资者可能面临小额赎回申请也需要部分延期办理的风险。</p> <p>2、基金净值大幅波动的风险 单一投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动；单一投资者大额赎回时，相应的赎回费归入基金资产以及赎回时的份额净值的精度问题均可能引起基金份额净值出现较大波动。</p> <p>3、基金投资策略难以实现的风险 单一投资者大额赎回后，可能使基金资产净值显著降低，从而使基金在拟参与银行间市场交易等投资时受到限制，导致基金投资策略难以实现。</p> <p>4、基金财产清算（或转型）的风险 根据本基金基金合同的约定，基金合同生效后的存续期内，若连续60个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金合同将终止，并根据基金合同的约定进行基金财产清算。单一投资者大额赎回后，可能造成基金资产净值大幅缩减而直接导致触发本基金合同约定的终止及清算条款，对本基金的继续存续产生较大影响。</p> <p>5、召开基金份额持有人大会及表决时可能存在的风险 由于单一机构投资者所持有的基金份额占比较高，在召开持有人大会并对重大事项进行投票表决时，单一机构投资者将拥有高的投票权重。</p>

注：本基金本报告期无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

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

《关于准予国投瑞银中证 500 指数量化增强型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2018]463号）

《关于国投瑞银中证 500 指数量化增强型证券投资基金备案确认的函》（机构部函[2018]1795号）

《国投瑞银中证 500 指数量化增强型证券投资基金基金合同》

《国投瑞银中证 500 指数量化增强型证券投资基金托管协议》
国投瑞银基金管理有限公司营业执照、公司章程及基金管理人业务资格批件
其他在中国证监会指定媒介上公开披露的基金份额净值公告、定期报告及临时公告

12.2 存放地点

中国广东省深圳市福田区福华一路 119 号安信金融大厦 18 楼

存放网址：<http://www.ubssdic.com>

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。

咨询电话：国投瑞银基金管理有限公司客户服务热线 400-880-6868

国投瑞银基金管理有限公司

二〇二四年八月三十日