

中银证券中证 500 交易型开放式指数证券 投资基金 2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：中银国际证券股份有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 4 月 30 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	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
3.3 其他指标	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
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	11
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	13
6.4 报表附注	14
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	52
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	52
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	52
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	52
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12 投资组合报告附注	53
§ 8 基金份额持有人信息	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2 期末上市基金前十名持有人	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	55
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4 基金投资策略的改变	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
10.8 其他重大事件	58
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	59
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	59
§ 12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	中银证券中证 500ETF
场内简称	BOCI500
基金主代码	515190
基金运作方式	契约型开放式（ETF）
基金合同生效日	2020 年 4 月 30 日
基金管理人	中银国际证券股份有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	249,466,080.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020 年 5 月 27 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。 当预期指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将通过投资非成份股、成份股个股衍生品等方式进行替代，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为交易型开放式指数基金，采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中银国际证券股份有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	亓磊	张燕
	联系电话	021-20328000	0755-83199084
	电子邮箱	gmkf@bocichina.com	yan_zhang@cmbchina.com

客户服务电话	021-61195566, 400-620-8888	95555
传真	021-50372474	0755-83195201
注册地址	上海市浦东新区银城中路 200 号 中银大厦 39F	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	上海市浦东新区银城中路 200 号 中银大厦 39F	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	200120	518040
法定代表人	宁敏	李建红

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.bocifunds.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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(2020年4月30日(基金合同生效日) - 2020年6月30日)
本期已实现收益	6,288,412.46
本期利润	24,372,758.22
加权平均基金份额本期利润	0.0908
本期加权平均净值利润率	8.85%
本期基金份额净值增长率	8.87%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	5,602,438.33
期末可供分配基金份额利润	0.0225
期末基金资产净值	271,581,992.42
期末基金份额净值	1.0887
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	8.87%

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

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

3、本基金合同于 2020 年 4 月 30 日生效，截至本报告期末基金成立未满一年。

3.2 基金净值表现

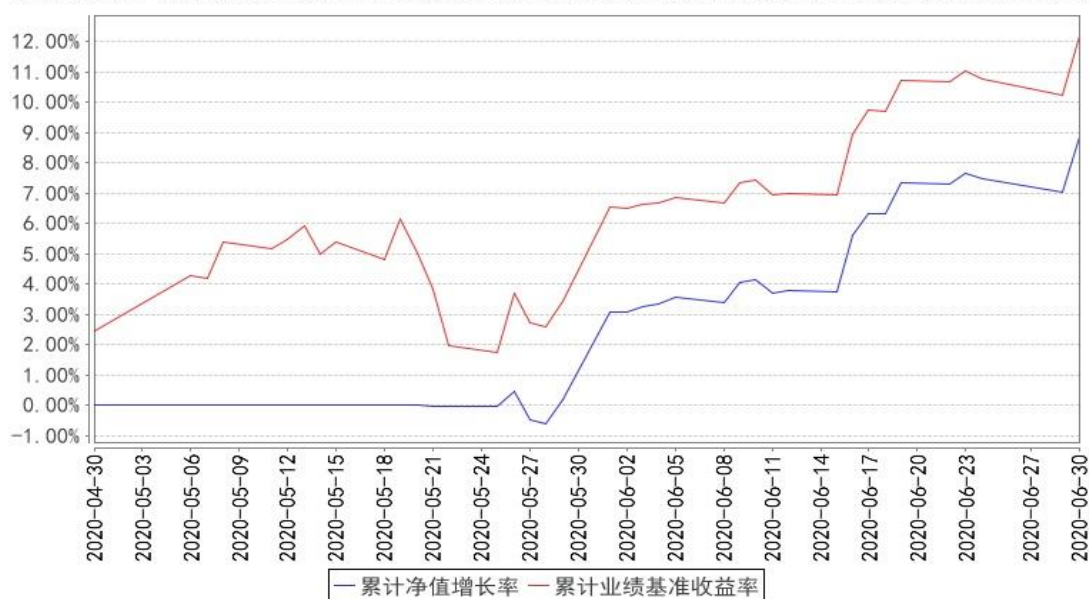
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	8.66%	0.84%	8.47%	0.88%	0.19%	-0.04%
自基金合同生效日起至今	8.87%	0.67%	12.20%	1.02%	-3.33%	-0.35%

注：本基金成立于 2020 年 4 月 30 日，本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



注：1. 本基金的基金合同于 2020 年 4 月 30 日生效；

2. 按照基金合同约定，自基金成立日起 6 个月为建仓期，截止本报告期末，基金已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

3.3 其他指标

注：无

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中银国际证券股份有限公司(以下简称“中银证券”)经中国证监会批准于 2002 年 2 月 28 日在上海成立,注册资本 27.78 亿元人民币。股东包括中银国际控股有限公司、中国石油集团资本有限责任公司、上海金融发展投资基金(有限合伙)、云南省投资控股集团有限公司、江西铜业股份有限公司、凯瑞富海实业投资有限公司、中国通用技术(集团)控股有限责任公司、上海祥众投资合伙企业(有限合伙)、江苏洋河酒厂股份有限公司、上海郝乾企业管理中心(有限合伙)、江西铜业集团财务有限公司、达濠市政建设有限公司、万兴投资发展有限公司、A 股公开发行普通股。中银国际证券的经营经营范围包括:证券经纪、证券投资咨询、与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问、证券承销与保荐、证券自营、证券资产管理、证券投资基金代销、融资融券、代销金融产品、公开募集证券投资基金管理业务、为期货公司提供中间介绍业务。截至 2020 年 6 月 30 日,本管理人共管理十八只证券投资基金,包括:中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金(原中银证券保本 1 号混合型证券投资基金)、中银证券健康产业灵活配置混合型证券投资基金、中银证券现金管家货币市场基金、中银证券安进债券型证券投资基金、中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金、中银证券安弘债券型证券投资基金、中银证券汇宇定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券聚瑞混合型证券投资基金、中银证券祥瑞混合型证券投资基金、中银证券汇嘉定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券安誉债券型证券投资基金、中银证券汇享定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券新能源灵活配置混合型证券投资基金、中银证券安源债券型证券投资基金、中银证券中高等级债券型证券投资基金、中银证券安泽债券型证券投资基金、中银证券科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金。

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		
阳桦	本基金的基金经理	2020 年 4 月 30 日	-	12	阳桦, 硕士研究生, 中国国籍, 已取得证券、基金从业资格。2008 年 7 月至 2009 年 6 月任职于富邦证券(上海代表处), 担任行业研究员; 2009 年 7 月至 2010 年 6 月任职于中山证券有限责任公司, 担任行

					业研究员；2010 年 6 月加入中银国际证券股份有限公司，担任行业研究员、投资经理，现任中银证券祥瑞混合型证券投资基金、中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金、中银证券科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了保证公司管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益，本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，建立了基金管理业务、资产管理业务公平交易管理办法、研究与交易部交易室异常交易监控与报告管理办法等公平交易相关制度体系。公司基金管理业务、资产管理业务公平交易管理办法所规范的范围涵盖境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，同时涵盖包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内，本基金自上市以来，日均跟踪偏离度为 0.01%，年化跟踪误差为 0.71%，符合基金合同约定的日均跟踪偏离度绝对值不超过 0.2%、年化跟踪误差不超过 2%的限制。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0887 元；本报告期基金份额净值增长率为 8.87%，业绩比较基准收益率为 12.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金作为一只投资于中证 500 指数的被动投资管理产品，我们继续秉承指数化被动投资策略，积极应对基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，降低本基金的跟踪误差，给投资者提供一个标准化的中证 500 指数的投资工具。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了中银国际证券股份有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。由公司领导担任主席，成员由资产管理板块负责人、基金管理部、信评与投资监督、业务营运部、内控与法律合规部、风险管理部等部门负责人组成。估值委员会成员均具有专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力，具有绝对的独立性。估值委员会的职责主要包括有：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

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

本半年度/年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	4,696,523.44
结算备付金		2,735,640.17
存出保证金		71,475.14
交易性金融资产	6.4.7.2	264,806,134.39
其中：股票投资		264,806,134.39
基金投资		-

债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		87,599.10
应收利息	6.4.7.5	1,748.98
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	91,189.63
资产总计		272,490,310.85
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年6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		-
应付证券清算款		624,378.42
应付赎回款		-
应付管理人报酬		36,507.33
应付托管费		12,169.10
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	153,266.63
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	81,996.95
负债合计		908,318.43
所有者权益:		
实收基金	6.4.7.9	249,466,080.00
未分配利润	6.4.7.10	22,115,912.42
所有者权益合计		271,581,992.42
负债和所有者权益总计		272,490,310.85

注：本基金合同生效日为 2020 年 04 月 30 日，本报告期自基金合同生效日 2020 年 04 月 30 日起至 2020 年 06 月 30 日止。报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0887 元，基金份额总额 249,466,080.00 份。

6.2 利润表

会计主体：中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2020 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		25,087,960.48
1. 利息收入		70,914.35
其中：存款利息收入	6.4.7.11	70,914.35
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		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		6,550,165.10
其中：股票投资收益	6.4.7.12	4,983,909.36
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	1,566,255.74
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	18,084,345.76
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	382,535.27
减：二、费用		715,202.26
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	68,508.51
2. 托管费	6.4.10.2.2	22,836.21
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.19	518,128.56
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.20	105,728.98
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		24,372,758.22
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		24,372,758.22

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	251,466,080.00	-	251,466,080.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	24,372,758.22	24,372,758.22
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-2,000,000.00	-2,256,845.80	-4,256,845.80
其中：1. 基金申购款	96,000,000.00	2,041,502.41	98,041,502.41
2. 基金赎回款	-98,000,000.00	-4,298,348.21	-102,298,348.21
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	249,466,080.00	22,115,912.42	271,581,992.42

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：

宁敏

沈锋

戴景义

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]2051 号《关于准予中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准, 由中银国际证券股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式基金, 存续期限不定, 首次设立募集不包括认购资金利息共募集人

人民币 251,438,000.00 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第 0351 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2020 年 4 月 30 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 251,438,000.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 28,080.00 份基金份额。本基金的基金管理人为中银国际证券股份有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数的指数成分股及其备选成分股。为更好的实现投资目标，本基金还可投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、股指期货、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债的纯债部分、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持债券、政府支持机构债券等)、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款和其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、资产支持证券、债券回购以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可以根据相关法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。业绩比较基准为：中证 500 指数。

本财务报表由本基金的基金管理人中银国际证券股份有限公司于 2020 年 8 月 31 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》、各项具体会计准则及相关规定(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》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中银证券安弘债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年 4 月 30 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 4 月 30 日至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

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。本期财务报表的实际编制期间为自 2020 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日。

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

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。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。

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于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项和其他金融负债的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。

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

基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。

对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上的，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认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

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认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

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。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债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利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分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利息收入。

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和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他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

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所有者权益转出。

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和债券，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、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(资产支持证券和私募债券除外)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《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度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(资产支持证券和私募债券除外)，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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。

(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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	4,696,523.44
定期存款	-
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	-
合计	4,696,523.44

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	246,721,788.63	264,806,134.39	18,084,345.76
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	246,721,788.63	264,806,134.39	18,084,345.76

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	485.78
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,231.10
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-

应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	32.10
合计	1,748.98

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
其他应收款	-
待摊费用	91,189.63
合计	91,189.63

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	153,266.63
银行间市场应付交易费用	-
合计	153,266.63

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	58,150.80
应付指数使用费	23,846.15
合计	81,996.95

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年4月30日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	251,466,080.00	251,466,080.00
本期申购	96,000,000.00	96,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-98,000,000.00	-98,000,000.00
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	249,466,080.00	249,466,080.00

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	6,288,412.46	18,084,345.76	24,372,758.22
本期基金份额交易产生的变动数	-685,974.13	-1,570,871.67	-2,256,845.80
其中：基金申购款	131,505.71	1,909,996.70	2,041,502.41
基金赎回款	-817,479.84	-3,480,868.37	-4,298,348.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,602,438.33	16,513,474.09	22,115,912.42

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年4月30日（基金合同生效日）至2020年6月30日
活期存款利息收入	67,251.06
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	3,570.08
其他	93.21
合计	70,914.35

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2020年4月30日（基金合同生效日）至2020年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	3,274,979.97
股票投资收益——赎回差价收入	1,708,929.39
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	4,983,909.36

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年4月30日（基金合同生效日）至2020年6月30日
卖出股票成交总额	120,794,031.02
减：卖出股票成本总额	117,519,051.05

买卖股票差价收入	3,274,979.97
----------	--------------

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年4月30日（基金合同生效日）至2020年6月30日
赎回基金份额对价总额	102,298,348.21
减：现金支付赎回款总额	56,351,391.21
减：赎回股票成本总额	44,238,027.61
赎回差价收入	1,708,929.39

6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益-买卖债券差价收入。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-申购差价收入。

6.4.7.15 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

注：本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益-其他投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月30日（基金合同生效日）至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,566,255.74
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	1,566,255.74

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年4月30日（基金合同生效日）至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	18,084,345.76
股票投资	18,084,345.76

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	18,084,345.76

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月30日（基金合同生效日）至2020年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	336,500.27
其他	46,035.00
合计	382,535.27

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月30日（基金合同生效日）至2020年6月30日
交易所市场交易费用	518,128.56
银行间市场交易费用	-
合计	518,128.56

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月30日（基金合同生效日）至2020年6月30日
审计费用	15,121.80
信息披露费	22,682.70
证券出借违约金	-
银行费用	521.66
账户维护费	1,500.00
其他费用	42,056.67
指数使用费	23,846.15
合计	105,728.98

6.4.7.21 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。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

无

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中银国际证券股份有限公司（“中银证券”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行股份有限公司”）	基金托管人
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金管理人股东的控股股东、基金销售机构
中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“中银中证 500ETF 联接基金”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）

中银证券	484,564,365.31	100.00
------	----------------	--------

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年4月30日（基金合同生效日）至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
中银证券	354,237.39	100.00	153,266.63	100.00

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等。

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 2020年4月30日（基金合同生效日）至2020年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费
其中：支付销售机构的客户维护费	0.33

注：支付基金管理人中银证券的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.150% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为： $\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.150\% / \text{当年天数}$ 。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	
	2020 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日	
当期发生的基金应支付的托管费	22,836.21	

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为： $\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}$ 。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金本报告期内无支付给各关联方的销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期本基金的管理人未运用固有资金申赎及买卖本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末	
	2020 年 6 月 30 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）
联接基金	131,592,600.00	52.75

6.4.10.5 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	
	2020 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	4,696,523.44	67,251.06

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末(2020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	可流通日	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
002500	山西证券	2020年6月29日	2020年7月10日	配股流通受限	5.00	6.54	33,030	165,150.00	216,016.20	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601880	大连港	2020年6月22日	重大事项	1.72	2020年7月8日	1.89	165,800	283,949.35	285,176.00	-
002470	*ST金正	2020年6月30日	重大事项	2.27	2020年7月1日	2.16	90,300	211,718.63	204,981.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

6.4.13 金融工具风险及管理

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

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金，紧密跟踪中证 500 指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪中证 500 指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人在公司风险管理体系的基础上构建明晰基金业务的风险管理组织架构和职能，由董事会及其风险控制委员会、执行委员会、风险管理委员会、风险管理部、基金管理部、中后线部门等相关业务部门构成多层次风险管理框架体系。董事会决定公司风险偏好，并在风险控制委员会的协助下监察公司基金业务的总体风险及管理状况。执行委员会领导公司基金业务的风险管理。风险管理委员会协助执行委员会在董事会授权范围内确定、调整基金业务的业务权限、讨论重大决策以及检查风险管理状况。风险管理部负责监控和报告公司基金业务的风险敞口和限额使用情况。业务主管对各自业务的风险管理负有首要责任。财务、业务营运、稽核、法律及合规等中后线部门在各自职能范围内支持或监督公司风险管理。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行，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，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：截至 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有期限在一年以内（含）的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：截至 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有期限在一年以内（含）的债券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：截至 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有期限在一年以内（含）的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：截至 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有期限大于一年的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：截至 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有期限大于一年的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：截至 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有期限大于一年的同业存单。

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于约定开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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 2020 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 43,999,562.00 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同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(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约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

注：截至 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有期限大于一年的同业存单。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期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上市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该比例限制)。

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，部分基金资产流暂时受限制不能自由转让的情况参见附注。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2020 年 6 月 30 日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2020 年 6 月 30 日，本基金确认的净赎回申请未超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易

的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

注：流动性受限资产、7 个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金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。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、债券投资和买入返售金融资产等，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,696,523.44	-	-	-	4,696,523.44
结算备付金	2,735,640.17	-	-	-	2,735,640.17
存出保证金	71,475.14	-	-	-	71,475.14
交易性金融资产	-	-	-	264,806,134.39	264,806,134.39
应收利息	-	-	-	1,748.98	1,748.98
应收证券清算款	-	-	-	87,599.10	87,599.10

其他资产	-	-	-	91,189.63	91,189.63
资产总计	7,503,638.75	-	-	264,986,672.10	272,490,310.85
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	36,507.33	36,507.33
应付托管费	-	-	-	12,169.10	12,169.10
应付证券清算款	-	-	-	624,378.42	624,378.42
应付交易费用	-	-	-	153,266.63	153,266.63
其他负债	-	-	-	81,996.95	81,996.95
负债总计	-	-	-	908,318.43	908,318.43
利率敏感度缺口	7,503,638.75	-	-	-264,078,353.67	271,581,992.42

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：截至 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有期限大于一年的同业存单。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：不适用。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：不适用。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券，因此无重大其他价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 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	264,806,134.39	97.51
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	264,806,134.39	97.51

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	-	
	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（2020年6月30日）
分析	业绩比较基准上升 5%	12,719,542.61
	业绩比较基准下降 5%	-12,719,542.61

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：不适用。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值 于 2020 年 6 月 30 日，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中属于第一层次的余额为 264,315,977.39 元，第二层次余额为 490,157.00 元，无第三层次的余额。

(ii) 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公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具 于 2020 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。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	264,806,134.39	97.18
	其中：股票	264,806,134.39	97.18
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	7,432,163.61	2.73
8	其他各项资产	252,012.85	0.09
9	合计	272,490,310.85	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,385,335.00	0.88
B	采矿业	6,257,723.50	2.30
C	制造业	153,664,450.92	56.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,122,774.00	2.25
E	建筑业	3,521,447.00	1.30
F	批发和零售业	14,680,573.40	5.41
G	交通运输、仓储和邮政业	5,569,243.40	2.05
H	住宿和餐饮业	914,490.00	0.34
I	信息传输、软件和信息技术服务业	30,214,845.00	11.13
J	金融业	13,650,775.77	5.03
K	房地产业	9,349,004.40	3.44
L	租赁和商务服务业	5,392,044.00	1.99
M	科学研究和技术服务业	1,935,187.00	0.71
N	水利、环境和公共设施管理业	2,546,114.00	0.94
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	284,832.00	0.10
Q	卫生和社会工作	1,913,750.00	0.70
R	文化、体育和娱乐业	4,120,636.00	1.52
S	综合	2,282,909.00	0.84
	合计	264,806,134.39	97.51

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

注：本基金本报告期无积极股票投资。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期无港股通股票投资。

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	300253	卫宁健康	90,850	2,084,099.00	0.77
2	002127	南极电商	91,500	1,937,055.00	0.71
3	600201	生物股份	60,500	1,684,320.00	0.62
4	600739	辽宁成大	85,900	1,626,087.00	0.60
5	002185	华天科技	117,300	1,587,069.00	0.58
6	002821	凯莱英	6,529	1,586,547.00	0.58
7	603444	吉比特	2,700	1,482,327.00	0.55
8	002131	利欧股份	381,500	1,472,590.00	0.54
9	300558	贝达药业	10,500	1,469,790.00	0.54
10	300088	长信科技	130,500	1,461,600.00	0.54
11	002439	启明星辰	34,000	1,430,380.00	0.53
12	300012	华测检测	71,200	1,406,912.00	0.52
13	600079	人福医药	51,400	1,399,108.00	0.52
14	600529	山东药玻	23,700	1,374,600.00	0.51
15	600298	安琪酵母	27,100	1,340,908.00	0.49
16	600521	华海药业	39,480	1,339,556.40	0.49
17	300285	国瓷材料	39,100	1,310,241.00	0.48
18	600161	天坛生物	28,900	1,310,037.00	0.48
19	002385	大北农	143,600	1,308,196.00	0.48
20	002465	海格通信	99,500	1,287,530.00	0.47
21	600143	金发科技	96,900	1,276,173.00	0.47
22	300595	欧普康视	17,900	1,241,186.00	0.46
23	603517	绝味食品	17,000	1,202,580.00	0.44
24	002212	南洋股份	45,000	1,196,100.00	0.44
25	300482	万孚生物	11,500	1,196,000.00	0.44
26	000009	中国宝安	139,600	1,187,996.00	0.44
27	002075	沙钢股份	94,600	1,182,500.00	0.44
28	603882	金城医学	13,100	1,172,450.00	0.43
29	601099	太平洋	366,900	1,163,073.00	0.43
30	002223	鱼跃医疗	31,600	1,150,240.00	0.42
31	300212	易华录	20,300	1,136,800.00	0.42
32	300418	昆仑万维	45,500	1,135,680.00	0.42
33	000636	风华高科	38,800	1,132,572.00	0.42
34	002273	水晶光电	66,000	1,131,240.00	0.42
35	002074	国轩高科	41,500	1,113,860.00	0.41
36	601128	常熟银行	147,700	1,109,227.00	0.41
37	300357	我武生物	17,800	1,108,050.00	0.41
38	002507	涪陵榨菜	30,700	1,105,507.00	0.41
39	300496	中科创达	14,200	1,103,340.00	0.41
40	300207	欣旺达	58,300	1,101,870.00	0.41
41	300315	掌趣科技	148,800	1,090,704.00	0.40
42	600426	华鲁恒升	61,200	1,082,016.00	0.40

43	000975	银泰黄金	67,800	1,063,104.00	0.39
44	300168	万达信息	47,800	1,054,946.00	0.39
45	002603	以岭药业	33,200	1,035,508.00	0.38
46	000988	华工科技	42,300	1,033,389.00	0.38
47	603939	益丰药房	11,280	1,026,480.00	0.38
48	002340	格林美	204,800	1,017,856.00	0.37
49	600699	均胜电子	41,900	997,639.00	0.37
50	600845	宝信软件	16,800	992,544.00	0.37
51	002414	高德红外	33,860	991,420.80	0.37
52	002156	通富微电	39,300	984,465.00	0.36
53	002353	杰瑞股份	31,600	979,600.00	0.36
54	300271	华宇软件	34,600	976,066.00	0.36
55	002557	洽洽食品	18,000	975,420.00	0.36
56	002373	千方科技	40,600	973,994.00	0.36
57	600885	宏发股份	24,000	962,880.00	0.35
58	600132	重庆啤酒	13,100	956,300.00	0.35
59	002019	亿帆医药	40,400	927,988.00	0.34
60	600859	王府井	20,300	924,665.00	0.34
61	000513	丽珠集团	19,100	916,991.00	0.34
62	600315	上海家化	19,100	914,890.00	0.34
63	002195	二三四五	324,200	911,002.00	0.34
64	002500	山西证券	139,130	909,910.20	0.34
65	000750	国海证券	205,500	891,870.00	0.33
66	002030	达安基因	32,500	886,600.00	0.33
67	300017	网宿科技	103,900	882,111.00	0.32
68	002250	联化科技	40,400	880,720.00	0.32
69	000021	深科技	40,200	877,566.00	0.32
70	600801	华新水泥	36,700	870,157.00	0.32
71	600895	张江高科	42,600	867,762.00	0.32
72	002138	顺络电子	34,500	860,775.00	0.32
73	000547	航天发展	62,900	859,843.00	0.32
74	600380	健康元	52,900	859,096.00	0.32
75	603858	步长制药	29,700	856,845.00	0.32
76	002152	广电运通	65,500	847,570.00	0.31
77	300316	晶盛机电	34,200	846,108.00	0.31
78	300009	安科生物	47,180	844,522.00	0.31
79	601799	星宇股份	6,600	838,200.00	0.31
80	603233	大参林	10,320	838,190.40	0.31
81	600155	华创阳安	69,743	836,218.57	0.31
82	300070	碧水源	102,900	835,548.00	0.31
83	600667	太极实业	70,500	833,310.00	0.31
84	300058	蓝色光标	106,700	832,260.00	0.31

85	300024	机器人	60,700	829,769.00	0.31
86	000050	深天马 A	54,000	829,440.00	0.31
87	000998	隆平高科	49,700	827,505.00	0.30
88	002797	第一创业	119,500	826,940.00	0.30
89	002382	蓝帆医疗	27,400	825,014.00	0.30
90	000401	冀东水泥	51,100	819,644.00	0.30
91	002572	索菲亚	33,900	819,363.00	0.30
92	600037	歌华有线	53,100	807,120.00	0.30
93	600410	华胜天成	58,800	799,680.00	0.29
94	002078	太阳纸业	83,500	794,920.00	0.29
95	600126	杭钢股份	76,400	794,560.00	0.29
96	600535	天士力	48,900	793,158.00	0.29
97	600486	扬农化工	9,600	792,000.00	0.29
98	000623	吉林敖东	50,200	789,646.00	0.29
99	002690	美亚光电	15,000	789,000.00	0.29
100	600642	申能股份	131,800	778,938.00	0.29
101	002511	中顺洁柔	34,900	778,270.00	0.29
102	002174	游族网络	29,800	777,184.00	0.29
103	300274	阳光电源	53,700	772,743.00	0.28
104	600153	建发股份	95,200	771,120.00	0.28
105	002013	中航机电	97,000	766,300.00	0.28
106	603338	浙江鼎力	10,080	763,761.60	0.28
107	002396	星网锐捷	21,500	759,595.00	0.28
108	601233	桐昆股份	59,500	759,220.00	0.28
109	600879	航天电子	116,300	748,972.00	0.28
110	002926	华西证券	70,100	745,163.00	0.27
111	603707	健友股份	11,500	742,555.00	0.27
112	600167	联美控股	51,700	741,378.00	0.27
113	300244	迪安诊断	21,000	741,300.00	0.27
114	300010	豆神教育	37,600	735,832.00	0.27
115	300251	光线传媒	66,800	728,788.00	0.27
116	600884	杉杉股份	61,810	728,739.90	0.27
117	000739	普洛药业	30,800	717,332.00	0.26
118	600415	小商品城	146,400	712,968.00	0.26
119	600811	东方集团	160,200	708,084.00	0.26
120	600216	浙江医药	36,400	701,064.00	0.26
121	002281	光迅科技	21,300	699,918.00	0.26
122	600804	鹏博士	77,700	697,746.00	0.26
123	001914	招商积余	22,600	694,498.00	0.26
124	000630	铜陵有色	359,300	693,449.00	0.26
125	300115	长盈精密	30,300	692,355.00	0.25
126	600511	国药股份	16,900	687,323.00	0.25

127	603605	珀莱雅	3,800	684,076.00	0.25
128	600728	佳都科技	73,600	670,496.00	0.25
129	600909	华安证券	97,300	664,559.00	0.24
130	600528	中铁工业	75,100	662,382.00	0.24
131	002294	信立泰	22,200	658,452.00	0.24
132	300001	特锐德	31,400	657,516.00	0.24
133	002028	思源电气	32,000	654,720.00	0.24
134	002268	卫士通	30,600	653,004.00	0.24
135	300002	神州泰岳	104,700	648,093.00	0.24
136	000686	东北证券	75,900	641,355.00	0.24
137	002242	九阳股份	17,200	641,044.00	0.24
138	600959	江苏有线	170,100	639,576.00	0.24
139	000997	新大陆	40,000	639,200.00	0.24
140	603659	璞泰来	6,200	638,724.00	0.24
141	600460	士兰微	43,400	637,112.00	0.23
142	600779	水井坊	10,200	636,684.00	0.23
143	002081	金螳螂	81,000	636,660.00	0.23
144	600325	华发股份	89,900	634,694.00	0.23
145	600733	北汽蓝谷	98,100	630,783.00	0.23
146	000581	威孚高科	30,500	630,740.00	0.23
147	600418	江淮汽车	71,000	626,930.00	0.23
148	601689	拓普集团	22,300	622,170.00	0.23
149	600598	北大荒	38,500	619,850.00	0.23
150	002387	维信诺	43,400	619,752.00	0.23
151	600446	金证股份	31,700	614,980.00	0.23
152	600827	百联股份	42,200	609,790.00	0.22
153	603000	人民网	30,700	608,781.00	0.22
154	000564	供销大集	135,100	606,599.00	0.22
155	002670	国盛金控	66,000	603,900.00	0.22
156	000878	云南铜业	56,700	601,587.00	0.22
157	601168	西部矿业	103,400	599,720.00	0.22
158	000999	华润三九	20,500	598,395.00	0.22
159	002317	众生药业	34,800	597,168.00	0.22
160	600256	广汇能源	219,300	592,110.00	0.22
161	300026	红日药业	107,200	591,744.00	0.22
162	603806	福斯特	11,840	590,934.40	0.22
163	600497	驰宏锌锗	171,600	590,304.00	0.22
164	002368	太极股份	13,400	585,446.00	0.22
165	600008	首创股份	192,900	580,629.00	0.21
166	300296	利亚德	95,400	579,078.00	0.21
167	600820	隧道股份	102,300	577,995.00	0.21
168	600704	物产中大	136,600	575,086.00	0.21

169	600839	四川长虹	199,400	572,278.00	0.21
170	600260	凯乐科技	42,100	569,192.00	0.21
171	300113	顺网科技	22,000	558,800.00	0.21
172	300166	东方国信	45,000	558,450.00	0.21
173	002080	中材科技	36,000	558,000.00	0.21
174	600572	康恩贝	100,900	554,950.00	0.20
175	600673	东阳光	80,300	554,873.00	0.20
176	002124	天邦股份	42,700	548,695.00	0.20
177	002221	东华能源	62,400	548,496.00	0.20
178	000158	常山北明	52,000	542,880.00	0.20
179	000800	一汽解放	49,800	534,852.00	0.20
180	601179	中国西电	110,400	534,336.00	0.20
181	600718	东软集团	46,400	533,600.00	0.20
182	600549	厦门钨业	44,900	531,616.00	0.20
183	002217	合力泰	101,200	531,300.00	0.20
184	603866	桃李面包	10,400	529,256.00	0.19
185	600645	中源协和	18,700	528,275.00	0.19
186	300618	寒锐钴业	8,500	527,170.00	0.19
187	600060	海信视像	43,300	526,095.00	0.19
188	601966	玲珑轮胎	26,000	525,200.00	0.19
189	600862	中航高科	31,000	524,520.00	0.19
190	600875	东方电气	59,200	523,920.00	0.19
191	000729	燕京啤酒	76,400	523,340.00	0.19
192	603883	老百姓	5,200	520,208.00	0.19
193	600021	上海电力	69,900	517,260.00	0.19
194	002831	裕同科技	18,700	514,437.00	0.19
195	002709	天赐材料	15,200	513,608.00	0.19
196	600567	山鹰纸业	173,400	511,530.00	0.19
197	600881	亚泰集团	175,600	510,996.00	0.19
198	600094	大名城	85,800	510,510.00	0.19
199	002920	德赛西威	8,300	509,039.00	0.19
200	600171	上海贝岭	29,000	504,020.00	0.19
201	300630	普利制药	6,800	502,860.00	0.19
202	000877	天山股份	33,300	502,830.00	0.19
203	000060	中金岭南	134,500	500,340.00	0.18
204	600754	锦江酒店	18,000	499,500.00	0.18
205	600160	巨化股份	72,400	498,836.00	0.18
206	603568	伟明环保	21,400	496,480.00	0.18
207	002458	益生股份	32,400	494,748.00	0.18
208	603228	景旺电子	14,000	492,660.00	0.18
209	002056	横店东磁	43,400	488,250.00	0.18
210	002203	海亮股份	55,800	488,250.00	0.18

211	000778	新兴铸管	141,500	485,345.00	0.18
212	600026	中远海能	74,900	483,854.00	0.18
213	002399	海普瑞	19,300	483,272.00	0.18
214	000090	天健集团	69,800	482,318.00	0.18
215	600580	卧龙电驱	42,900	482,196.00	0.18
216	002429	兆驰股份	97,300	481,635.00	0.18
217	600597	光明乳业	32,400	481,464.00	0.18
218	600273	嘉化能源	55,000	480,700.00	0.18
219	603712	七一二	12,500	479,750.00	0.18
220	002648	卫星石化	29,400	478,338.00	0.18
221	600566	济川药业	18,500	471,010.00	0.17
222	601005	重庆钢铁	315,400	469,946.00	0.17
223	601975	招商南油	196,300	469,157.00	0.17
224	000960	锡业股份	54,700	468,232.00	0.17
225	600967	内蒙一机	45,000	467,550.00	0.17
226	002233	塔牌集团	38,800	466,764.00	0.17
227	000629	攀钢钒钛	231,000	464,310.00	0.17
228	600282	南钢股份	142,500	460,275.00	0.17
229	002004	华邦健康	85,100	457,838.00	0.17
230	600755	厦门国贸	69,100	456,060.00	0.17
231	002807	江阴银行	115,900	455,487.00	0.17
232	002085	万丰奥威	70,100	454,248.00	0.17
233	002745	木林森	29,472	454,163.52	0.17
234	002635	安洁科技	18,200	453,180.00	0.17
235	600195	中牧股份	27,800	451,194.00	0.17
236	600064	南京高科	46,100	448,092.00	0.16
237	600039	四川路桥	117,200	447,704.00	0.16
238	600166	福田汽车	248,400	447,120.00	0.16
239	002110	三钢闽光	66,800	444,888.00	0.16
240	000970	中科三环	45,400	444,012.00	0.16
241	300182	捷成股份	111,100	443,289.00	0.16
242	601118	海南橡胶	91,200	443,232.00	0.16
243	000598	兴蓉环境	96,300	442,980.00	0.16
244	300133	华策影视	61,100	442,975.00	0.16
245	600737	中粮糖业	56,900	442,682.00	0.16
246	601860	紫金银行	103,800	439,074.00	0.16
247	000690	宝新能源	93,000	438,960.00	0.16
248	000681	视觉中国	23,500	437,570.00	0.16
249	600515	海航基础	83,900	436,280.00	0.16
250	600466	蓝光发展	80,300	432,817.00	0.16
251	000402	金融街	65,000	431,600.00	0.16
252	600373	中文传媒	36,500	429,970.00	0.16

253	600392	盛和资源	60,900	429,345.00	0.16
254	600022	山东钢铁	332,400	428,796.00	0.16
255	002506	协鑫集成	163,000	425,430.00	0.16
256	000967	盈峰环境	51,400	424,050.00	0.16
257	002048	宁波华翔	27,400	423,056.00	0.16
258	002183	怡亚通	78,900	422,904.00	0.16
259	600643	爱建集团	53,100	422,145.00	0.16
260	600633	浙数文化	43,000	420,540.00	0.15
261	000400	许继电气	31,800	419,760.00	0.15
262	002191	劲嘉股份	47,100	419,661.00	0.15
263	603816	顾家家居	9,300	418,593.00	0.15
264	002038	双鹭药业	32,600	417,606.00	0.15
265	600056	中国医药	29,500	417,425.00	0.15
266	600435	北方导航	55,200	417,312.00	0.15
267	000415	渤海租赁	139,600	416,008.00	0.15
268	600808	马钢股份	161,000	415,380.00	0.15
269	601106	中国一重	147,800	415,318.00	0.15
270	000089	深圳机场	54,200	415,172.00	0.15
271	600258	首旅酒店	27,000	414,990.00	0.15
272	002375	亚厦股份	40,600	414,932.00	0.15
273	002092	中泰化学	91,500	414,495.00	0.15
274	000983	西山煤电	110,050	412,687.50	0.15
275	601098	中南传媒	39,000	412,620.00	0.15
276	600729	重庆百货	13,200	412,104.00	0.15
277	600120	浙江东方	59,840	411,100.80	0.15
278	002595	豪迈科技	21,100	410,606.00	0.15
279	601333	广深铁路	182,400	410,400.00	0.15
280	000039	中集集团	56,700	409,941.00	0.15
281	000825	太钢不锈	122,700	407,364.00	0.15
282	000930	中粮科技	59,600	407,068.00	0.15
283	000738	航发控制	29,800	406,770.00	0.15
284	002839	张家港行	70,500	406,080.00	0.15
285	000830	鲁西化工	54,200	404,332.00	0.15
286	300324	旋极信息	60,700	404,262.00	0.15
287	600376	首开股份	68,800	403,168.00	0.15
288	600675	中华企业	98,500	400,895.00	0.15
289	601615	明阳智能	32,100	399,645.00	0.15
290	600649	城投控股	67,200	399,168.00	0.15
291	002640	跨境通	61,400	398,486.00	0.15
292	600563	法拉电子	6,400	395,520.00	0.15
293	000563	陕国投 A	106,100	393,631.00	0.14
294	000501	鄂武商 A	25,000	392,000.00	0.14

295	002407	多氟多	36,800	391,552.00	0.14
296	600776	东方通信	25,900	390,831.00	0.14
297	601866	中远海发	212,300	390,632.00	0.14
298	601718	际华集团	117,500	390,100.00	0.14
299	603486	科沃斯	12,900	389,709.00	0.14
300	300180	华峰超纤	45,400	388,624.00	0.14
301	002372	伟星新材	33,300	387,279.00	0.14
302	002925	盈趣科技	6,600	382,404.00	0.14
303	002064	华峰氨纶	75,100	380,757.00	0.14
304	600062	华润双鹤	28,800	380,736.00	0.14
305	000012	南玻A	75,600	379,512.00	0.14
306	002010	传化智联	69,500	378,080.00	0.14
307	000078	海王生物	89,900	376,681.00	0.14
308	002583	海能达	49,600	376,464.00	0.14
309	603077	和邦生物	284,600	375,672.00	0.14
310	002244	滨江集团	87,600	374,052.00	0.14
311	000932	华菱钢铁	99,200	373,984.00	0.14
312	600500	中化国际	73,600	372,416.00	0.14
313	300474	景嘉微	5,500	370,150.00	0.14
314	600266	城建发展	72,720	368,690.40	0.14
315	600388	龙净环保	41,800	367,840.00	0.14
316	000959	首钢股份	85,500	367,650.00	0.14
317	000883	湖北能源	104,200	366,784.00	0.14
318	000807	云铝股份	84,000	366,240.00	0.13
319	002563	森马服饰	51,900	365,895.00	0.13
320	000301	东方盛虹	65,700	365,292.00	0.13
321	000685	中山公用	47,400	364,980.00	0.13
322	002815	崇达技术	18,000	364,140.00	0.13
323	601699	潞安环能	65,000	362,050.00	0.13
324	600640	号百控股	18,100	361,095.00	0.13
325	600316	洪都航空	22,800	360,240.00	0.13
326	000027	深圳能源	77,400	359,136.00	0.13
327	000559	万向钱潮	74,200	359,128.00	0.13
328	600863	内蒙华电	145,400	357,684.00	0.13
329	002936	郑州银行	103,580	356,315.20	0.13
330	601000	唐山港	159,700	356,131.00	0.13
331	000987	越秀金控	30,500	355,630.00	0.13
332	000519	中兵红箭	37,700	355,134.00	0.13
333	000488	晨鸣纸业	71,600	353,704.00	0.13
334	002444	巨星科技	29,700	352,836.00	0.13
335	002155	湖南黄金	44,600	351,448.00	0.13
336	002625	光启技术	48,200	349,450.00	0.13

337	000031	大悦城	68,400	348,156.00	0.13
338	000528	柳工	54,700	345,157.00	0.13
339	300459	金科文化	99,800	344,310.00	0.13
340	300072	三聚环保	80,100	342,828.00	0.13
341	002440	闰土股份	37,200	340,008.00	0.13
342	600782	新钢股份	83,300	339,864.00	0.13
343	600908	无锡银行	69,000	338,790.00	0.12
344	002266	浙富控股	86,830	336,032.10	0.12
345	600777	新潮能源	219,500	333,640.00	0.12
346	600073	上海梅林	35,000	332,150.00	0.12
347	002424	贵州百灵	40,000	332,000.00	0.12
348	002434	万里扬	37,800	328,104.00	0.12
349	600823	世茂股份	73,400	328,098.00	0.12
350	002589	瑞康医药	61,000	326,960.00	0.12
351	601958	金钼股份	52,800	326,304.00	0.12
352	601717	郑煤机	55,200	325,128.00	0.12
353	000028	国药一致	7,200	324,072.00	0.12
354	000156	华数传媒	29,900	323,817.00	0.12
355	002701	奥瑞金	76,400	320,116.00	0.12
356	600312	平高电气	42,900	318,318.00	0.12
357	600765	中航重机	31,100	317,842.00	0.12
358	601608	中信重工	92,700	317,034.00	0.12
359	600291	西水股份	35,000	316,750.00	0.12
360	000046	泛海控股	83,600	315,172.00	0.12
361	000887	中鼎股份	40,000	314,000.00	0.12
362	000898	鞍钢股份	128,100	313,845.00	0.12
363	600409	三友化工	67,200	313,152.00	0.12
364	000758	中色股份	74,500	311,410.00	0.11
365	002901	大博医疗	2,600	310,154.00	0.11
366	002505	大康农业	137,700	309,825.00	0.11
367	600835	上海机电	18,300	309,819.00	0.11
368	000008	神州高铁	103,900	305,466.00	0.11
369	601228	广州港	100,400	305,216.00	0.11
370	600557	康缘药业	21,900	304,848.00	0.11
371	600545	卓郎智能	64,200	303,666.00	0.11
372	600751	海航科技	96,800	302,984.00	0.11
373	002390	信邦制药	65,900	300,504.00	0.11
374	002002	鸿达兴业	83,200	300,352.00	0.11
375	000712	锦龙股份	24,000	300,000.00	0.11
376	000813	德展健康	48,100	298,220.00	0.11
377	600138	中青旅	30,200	298,074.00	0.11
378	600507	方大特钢	57,400	297,906.00	0.11

379	600158	中体产业	36,300	296,934.00	0.11
380	601200	上海环境	24,700	296,400.00	0.11
381	002503	搜于特	105,400	296,174.00	0.11
382	600478	科力远	62,500	294,375.00	0.11
383	600259	广晟有色	9,800	294,000.00	0.11
384	600970	中材国际	55,200	291,456.00	0.11
385	600717	天津港	65,820	290,924.40	0.11
386	000826	启迪环境	38,800	287,896.00	0.11
387	601880	大连港	165,800	285,176.00	0.11
388	603377	东方时尚	17,200	284,832.00	0.10
389	601928	凤凰传媒	41,800	284,240.00	0.10
390	603198	迎驾贡酒	13,000	283,010.00	0.10
391	603885	吉祥航空	30,800	280,280.00	0.10
392	300134	大富科技	20,000	279,600.00	0.10
393	002249	大洋电机	76,900	277,609.00	0.10
394	002408	齐翔腾达	44,600	276,966.00	0.10
395	000732	泰禾集团	54,400	276,896.00	0.10
396	600348	阳泉煤业	65,400	275,988.00	0.10
397	600125	铁龙物流	49,300	275,094.00	0.10
398	600639	浦东金桥	17,200	274,856.00	0.10
399	600329	中新药业	15,800	273,656.00	0.10
400	601598	中国外运	84,700	273,581.00	0.10
401	600648	外高桥	19,300	272,902.00	0.10
402	000061	农产品	36,500	270,465.00	0.10
403	002665	首航高科	109,300	266,692.00	0.10
404	002302	西部建设	27,700	265,920.00	0.10
405	600582	天地科技	89,800	263,114.00	0.10
406	300376	易事特	50,100	260,520.00	0.10
407	002867	周大生	11,700	259,389.00	0.10
408	600307	酒钢宏兴	168,200	259,028.00	0.10
409	000990	诚志股份	20,400	258,876.00	0.10
410	000062	深圳华强	17,800	258,812.00	0.10
411	601611	中国核建	41,400	255,852.00	0.09
412	600748	上实发展	49,800	254,478.00	0.09
413	600141	兴发集团	28,200	252,390.00	0.09
414	600901	江苏租赁	48,000	250,080.00	0.09
415	000717	韶钢松山	65,800	250,040.00	0.09
416	000718	苏宁环球	80,900	249,981.00	0.09
417	603983	丸美股份	2,900	249,487.00	0.09
418	002419	天虹股份	26,000	248,300.00	0.09
419	600017	日照港	99,600	248,004.00	0.09
420	600664	哈药股份	80,200	247,016.00	0.09

421	002416	爱施德	34,400	246,992.00	0.09
422	603888	新华网	11,000	245,960.00	0.09
423	601678	滨化股份	57,800	245,072.00	0.09
424	000543	皖能电力	60,900	244,818.00	0.09
425	002093	国脉科技	27,600	244,260.00	0.09
426	000848	承德露露	34,400	240,800.00	0.09
427	600277	亿利洁能	73,700	240,262.00	0.09
428	600869	智慧能源	59,400	237,600.00	0.09
429	002948	青岛银行	45,900	233,631.00	0.09
430	002128	露天煤业	30,000	232,500.00	0.09
431	002544	杰赛科技	17,500	230,125.00	0.08
432	603317	天味食品	4,100	227,878.00	0.08
433	300257	开山股份	17,400	227,418.00	0.08
434	000537	广宇发展	31,100	227,030.00	0.08
435	000869	张裕A	6,500	221,975.00	0.08
436	600565	迪马股份	79,500	221,805.00	0.08
437	603650	彤程新材	9,500	221,065.00	0.08
438	000553	安道麦A	24,500	220,990.00	0.08
439	603056	德邦股份	16,200	219,186.00	0.08
440	603786	科博达	2,900	218,515.00	0.08
441	603328	依顿电子	20,900	217,987.00	0.08
442	002653	海思科	8,100	215,541.00	0.08
443	600350	山东高速	34,800	213,672.00	0.08
444	002491	通鼎互联	41,400	211,968.00	0.08
445	603766	隆鑫通用	54,300	210,141.00	0.08
446	600339	中油工程	91,100	206,797.00	0.08
447	600787	中储股份	47,100	206,769.00	0.08
448	600770	综艺股份	43,000	206,400.00	0.08
449	300197	铁汉生态	81,000	205,740.00	0.08
450	603515	欧普照明	7,500	205,275.00	0.08
451	002470	*ST金正	90,300	204,981.00	0.08
452	601019	山东出版	32,100	200,625.00	0.07
453	000600	建投能源	38,900	198,001.00	0.07
454	002051	中工国际	27,100	197,288.00	0.07
455	600338	西藏珠峰	19,700	197,000.00	0.07
456	601139	深圳燃气	30,000	195,000.00	0.07
457	601016	节能风电	90,200	191,224.00	0.07
458	600657	信达地产	45,600	187,872.00	0.07
459	002118	紫鑫药业	42,200	187,368.00	0.07
460	002285	世联行	66,800	186,372.00	0.07
461	600053	九鼎投资	6,100	182,024.00	0.07
462	601869	长飞光纤	5,900	181,779.00	0.07

463	600985	淮北矿业	23,300	181,507.00	0.07
464	600707	彩虹股份	38,900	177,384.00	0.07
465	600428	中远海特	57,100	175,868.00	0.06
466	600575	淮河能源	83,300	174,097.00	0.06
467	601801	皖新传媒	31,300	174,028.00	0.06
468	600694	大商股份	7,100	170,329.00	0.06
469	000937	冀中能源	56,300	170,026.00	0.06
470	600006	东风汽车	42,000	169,260.00	0.06
471	600996	贵广网络	23,400	166,842.00	0.06
472	600757	长江传媒	31,900	162,371.00	0.06
473	600623	华谊集团	31,000	159,960.00	0.06
474	600874	创业环保	23,300	154,712.00	0.06
475	603868	飞科电器	3,100	152,923.00	0.06
476	002941	新疆交建	10,600	149,990.00	0.06
477	603556	海兴电力	10,200	147,288.00	0.05
478	601865	福莱特	7,700	144,760.00	0.05
479	000785	居然之家	17,700	140,184.00	0.05
480	600058	五矿发展	22,700	137,108.00	0.05
481	603355	莱克电气	5,100	126,939.00	0.05
482	601003	柳钢股份	28,100	124,483.00	0.05
483	002818	富森美	10,100	124,230.00	0.05
484	600903	贵州燃气	12,300	121,032.00	0.04
485	603379	三美股份	5,460	117,226.20	0.04
486	601127	小康股份	13,800	114,678.00	0.04
487	002946	新乳业	6,300	109,305.00	0.04
488	600335	国机汽车	23,400	108,108.00	0.04
489	000025	特力A	5,300	97,149.00	0.04
490	001872	招商港口	6,600	96,030.00	0.04
491	601512	中新集团	8,200	94,300.00	0.03
492	601969	海南矿业	18,600	90,768.00	0.03
493	603225	新凤鸣	8,400	83,832.00	0.03
494	002423	中粮资本	9,500	82,650.00	0.03
495	601811	新华文轩	7,900	80,343.00	0.03
496	603025	大豪科技	9,600	69,792.00	0.03
497	603256	宏和科技	6,100	69,784.00	0.03
498	600917	重庆燃气	9,700	69,258.00	0.03
499	601068	中铝国际	17,200	67,252.00	0.02
500	002957	科瑞技术	2,500	59,750.00	0.02

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

注：本基金本报告期无积极股票投资。

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	002371	北方华创	2,951,768.00	1.09
2	002821	凯莱英	2,785,145.85	1.03
3	002127	南极电商	2,692,362.50	0.99
4	300253	卫宁健康	2,472,085.47	0.91
5	002129	中环股份	2,393,709.00	0.88
6	002049	紫光国微	2,385,185.90	0.88
7	300014	亿纬锂能	2,354,955.00	0.87
8	002463	沪电股份	2,196,419.68	0.81
9	300383	光环新网	2,170,108.00	0.80
10	002384	东山精密	2,147,796.28	0.79
11	002185	华天科技	2,066,627.00	0.76
12	002131	利欧股份	2,054,545.00	0.76
13	002439	启明星辰	2,019,606.88	0.74
14	600745	闻泰科技	1,985,874.00	0.73
15	300529	健帆生物	1,978,438.06	0.73
16	002075	沙钢股份	1,953,905.00	0.72
17	300012	华测检测	1,933,329.00	0.71
18	000066	中国长城	1,907,719.00	0.70
19	002812	恩捷股份	1,895,248.00	0.70
20	300088	长信科技	1,823,595.00	0.67

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	300014	亿纬锂能	2,910,807.70	1.07
2	002371	北方华创	2,806,818.00	1.03
3	600745	闻泰科技	2,614,967.00	0.96
4	002129	中环股份	2,513,814.00	0.93
5	002384	东山精密	2,381,318.00	0.88
6	002049	紫光国微	2,165,915.00	0.80
7	002463	沪电股份	2,147,739.00	0.79
8	300383	光环新网	2,139,649.50	0.79
9	600584	长电科技	2,109,492.00	0.78
10	300529	健帆生物	2,042,267.00	0.75
11	002812	恩捷股份	1,962,561.00	0.72
12	600763	通策医疗	1,949,657.00	0.72
13	000066	中国长城	1,796,613.00	0.66
14	002065	东华软件	1,652,190.00	0.61

15	600536	中国软件	1,493,247.00	0.55
16	002821	凯莱英	1,439,818.00	0.53
17	601100	恒立液压	1,309,722.00	0.48
18	002180	纳思达	1,183,668.00	0.44
19	600150	中国船舶	1,013,320.00	0.37
20	300308	中际旭创	970,703.00	0.36

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	363,770,334.29
卖出股票收入（成交）总额	120,794,031.02

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：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

注：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

注：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

注：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

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末无股指期货投资。

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

注：本基金本报告期无国债期货投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期无国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期无国债期货投资。

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	71,475.14
2	应收证券清算款	87,599.10
3	应收股利	-
4	应收利息	1,748.98
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	91,189.63
8	其他	-
9	合计	252,012.85

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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

注：本基金本报告期无积极股票投资。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构	
		机构投资者	个人投资者

		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
2,406	103,684.99	225,350,980.00	90.33	24,115,100.00	9.67

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
联接基金	131,592,600.00	52.75

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	招商银行股份有限公司—中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	131,592,600.00	52.75
2	中信期货有限公司—中信期货工银量化宏观配置 2 号资产管理计划	15,005,400.00	6.02
3	海富通基金—建设银行—中国人寿—中国人寿保险(集团)公司委托海富通基金管理有限	15,005,400.00	6.02
4	中信期货—工商银行—中信期货工银量化精选 1 号集合资产管理计划	15,005,400.00	6.02
5	中意人寿保险有限公司—分红—团体年金债券、基金账户	15,000,000.00	6.01
6	创金合信基金—中国银行—创金合信鼎泰 34 号集合资产管理计划	10,003,600.00	4.01
7	中信证券—中国银行—中信证券瑞丰丰元 1 号集合资产管理计划	10,002,700.00	4.01
8	中银保险有限公司—传统保险产品	10,002,700.00	4.01
9	中国国际金融股份有限公司	3,583,180.00	1.44
10	王栓伟	1,429,700.00	0.57

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	1,000.00	0.0
------------------	----------	-----

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

注：本基金高管或基金经理未持有本基金

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020年4月30日） 基金份额总额	251,466,080.00
基金合同生效日起至报告期期末基金 总申购份额	96,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基 金总赎回份额	98,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金 拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	249,466,080.00

注：本基金基金合同于 2020 年 4 月 30 日生效。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2020年3月26日，管涛先生辞任公司独立董事与董事会审计委员会委员职务。同日，李军先生担任公司独立董事与董事会审计委员会委员职务。2020年6月29日，王海权先生辞任公司董事与董事会战略与发展委员会委员职务、廖胜森先生辞任公司董事与董事会风险控制委员会委员职务。同日，文兰女士担任公司董事与董事会战略与发展委员会委员职务、艾富华先生担任公司董事与董事会风险控制委员会委员职务。2020年2月，中银国际证券股份有限公司聘任亓磊为公司合规总监兼公司公募基金管理业务合规负责人，解聘赵向雷兼任的公司合规总监兼公司公募基金管理业务合规负责人职务。

本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

一、本报告期内，涉及基金管理人的诉讼事项如下：

1、中银国际证券股份有限公司诉天津顺航海运有限公司质押式证券回购纠纷。2018年5月，法院作出民事调解书。2019年2月，法院裁定受理被告破产清算一案。现已申报债权，并持续

跟进破产案件进程。

2、中银国际证券股份有限公司诉上海刚泰投资咨询股份有限公司等质押式证券回购纠纷案。

法院于 2019 年 3 月作出民事判决书，现已申请执行。

中银国际证券股份有限公司诉上海刚泰投资咨询股份有限公司实现担保物权案。法院于 2018 年 12 月作出民事裁定书，原告已申请执行。因股票处置条件尚不成熟，暂未发现被执行人有其他可供执行财产，故法院裁定终结本次执行程序。发现被执行人有可供执行财产的，可以再次申请执行。

中银国际证券股份有限公司诉刚泰集团有限公司保证合同纠纷案。法院于 2019 年 12 月作出民事判决书，现已申请执行。

3、中银国际证券股份有限公司诉上海云峰（集团）有限公司债务融资工具非公开定向发行协议争议案（代资管计划仲裁）。仲裁委于 2019 年 9 月作出裁定书，现已申请执行。

4、中银国际证券股份有限公司诉中国华阳经贸集团有限公司公司债券交易纠纷案（代资管计划诉讼）。法院于 2019 年 2 月分别就七项案件作出民事调解书，现已申请执行。

5、中银国际证券股份有限公司诉康得新复合材料集团股份有限公司公司债券交易纠纷案（代资管计划诉讼）。法院于 2019 年 6 月分别就两案作出民事判决书，现已申请执行。

6、隋萍诉中银中银国际证券股份有限公司沈阳和平南大街证券营业部（第一被告）、中银国际证券股份有限公司（第二被告）、易方达基金管理有限公司（第三被告）、招商基金管理有限公司（第四被告）合同纠纷。案件在一审审理中。

7、中银国际证券股份有限公司诉辅仁药业集团有限公司债务融资工具非公开定向发行协议争议仲裁案（代资管计划仲裁）。仲裁委于 2020 年 4 月作出裁定书，现已申请执行。

8、湖南崇安法律咨询有限公司诉中银国际证券股份有限公司太原平阳路证券营业部（被告一）、中银国际证券股份有限公司（被告二）侵害作品信息网络传播权纠纷。法院于 2020 年 1 月作出裁定书，准许原告撤诉。

9、刘哲诉中银国际证券股份有限公司劳动争议纠纷。案件在审理中。

10、张婷诉张伟（被告一）、陈建中（被告二）、中银国际证券股份有限公司（被告三）委托理财合同纠纷。案件在一审审理中。

11、东辰控股集团有限公司管理人诉中银国际证券股份有限公司破产撤销权纠纷。案件在一审审理中。

12、中银国际证券股份有限公司诉江苏宏图高科技股份有限公司债券交易纠纷（代资管计划诉讼）。法院已受理两案。

- 二、本报告期内，无涉及基金财产的诉讼事项；
- 三、本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

未有管理人、托管人及其高级管理人员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	
中银证券	4	484,564,365.31	100.00%	354,237.39	100.00%	-

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

2、今后基金专用交易席位的选择标准如下：

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

3、今后基金专用交易席位的选择程序如下：

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

注：无

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中银国际证券股份有限公司旗下基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2020 年 1 月 17 日
2	中银国际证券股份有限公司关于 2020 年春节假期延长期间暂停办理申购赎回等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司官网	2020 年 1 月 30 日
3	中银国际证券股份有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司官网	2020 年 3 月 3 日
4	中银国际证券股份有限公司关于推迟披露旗下基金 2019 年年度报告的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司官网	2020 年 3 月 24 日
5	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书	证券日报、公司官网、上交所	2020 年 3 月 25 日
6	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同	公司官网、上交所	2020 年 3 月 25 日
7	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议	公司官网、上交所	2020 年 3 月 25 日
8	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告	公司官网、上交所	2020 年 3 月 25 日
9	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	证券日报	2020 年 3 月 25 日
10	中银国际证券股份有限公司关于增加江苏汇林保大基金销售有限公司为旗下基金销售机构并进行费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司官网	2020 年 3 月 30 日
11	中银国际证券股份有限公司关于增加中信建投证券股份有限公司为旗下基金销售机构并进行费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司官网、上交所	2020 年 4 月 13 日
12	中银国际证券股份有限公司旗下基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2020 年 4 月 21 日
13	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金上网发售提示性公告	证券日报、公司官网、上交所	2020 年 4 月 22 日
14	中银国际证券股份有限公司关于增加北京百度百盈基金销售有限公司为旗下基金销售机构并进行费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、公司官网、上交所	2020 年 4 月 23 日

15	中银国际证券股份有限公司旗下基金 2019 年年度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2019 年 4 月 30 日
16	中银证券中证 500 交易型开放式指数基金基金合同生效公告	公司官网、证券日报、上交所	2020 年 5 月 6 日
17	关于中银证券中证 500ETF 增加中金公司为申购赎回代办证券公司的公告	证券日报、公司官网、上交所	2020 年 5 月 19 日
18	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	证券日报、公司官网、上交所	2020 年 5 月 22 日
19	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	公司官网、上交所	2020 年 5 月 22 日
20	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书提示性公告	证券日报	2020 年 5 月 22 日
21	关于中银证券中证 500ETF 增加招商证券为申购赎回代办证券公司的公告	证券日报、公司官网、上交所	2020 年 6 月 8 日

注：全部公告均在公司网站披露，部分公告在公司网站及报纸披露。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
联接基金	1	20200528-20200630	0.00	183,592,600.00	52,000,000.00	131,592,600.00	52.75

产品特有风险

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

除第 6 项在基金托管人处外，其余文件均在基金管理人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

中银国际证券股份有限公司

2020 年 8 月 31 日