

国联中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

2025 年中期报告

2025 年 06 月 30 日

基金管理人:国联基金管理有限公司

基金托管人:中国光大银行股份有限公司

送出日期:2025 年 08 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2025年8月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2025年01月01日起至2025年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
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.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现	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.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告.....	42
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	43
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	60
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	62
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	63
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	63
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	63
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	63
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	63
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63
7.12 投资组合报告附注	63
§8 基金份额持有人信息.....	65
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
8.2 期末上市基金前十名持有人	65
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	66

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.....	66
§9 开放式基金份额变动.....	66
§10 重大事件揭示.....	66
10.1 基金份额持有人大会决议.....	66
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.....	66
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	67
10.4 基金投资策略的改变.....	67
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	67
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.....	67
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	67
10.8 其他重大事件.....	68
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	69
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.....	70
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	70
§12 备查文件目录.....	70
12.1 备查文件目录.....	70
12.2 存放地点.....	70
12.3 查阅方式.....	70

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国联中证500交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	国联中证500ETF
场内简称	国联500（基金扩位简称：国联中证500ETF）
基金主代码	515550
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019年11月15日
基金管理人	国联基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	55,345,700.00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	2019年12月25日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构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（如流动性不足、成份股长期停牌、法律法规限制等）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，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，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	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为

	指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
--	---

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国联基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	曹健	王茵
	联系电话	010-56517000	010-63639180
	电子邮箱	caojian@gfund.com	wangyin@cebbank.com
客户服务电话		400-160-6000; 010-56517299	95595
传真		010-56517001	010-63639132
注册地址		深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路3086号大百汇广场31层02-04单元	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
办公地址		北京市东城区安定门外大街208号玖安广场A座11层	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码		100011	100033
法定代表人		王瑶	吴利军

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.gfund.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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

会计师事务所	上会会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市静安区威海路755号文新报业大厦25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 (2025年01月01日- 2025年06月30日)
本期已实现收益	-21,383.40
本期利润	3,273,452.54
加权平均基金份额本期利润	0.0594
本期加权平均净值利润率	4.68%
本期基金份额净值增长率	4.25%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2025年06月30日)
期末可供分配利润	17,409,062.06
期末可供分配基金份额利润	0.3146
期末基金资产净值	72,754,762.06
期末基金份额净值	1.3146
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2025年06月30日)
基金份额累计净值增长率	31.46%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	4.89%	0.78%	4.31%	0.79%	0.58%	-0.01%
过去三个月	2.08%	1.49%	0.98%	1.50%	1.10%	-0.01%
过去六个月	4.25%	1.34%	3.31%	1.36%	0.94%	-0.02%
过去一年	20.98%	1.69%	19.68%	1.72%	1.30%	-0.03%
过去三年	-3.20%	1.31%	-8.35%	1.35%	5.15%	-0.04%
自基金合同 生效起至今	31.46%	1.31%	20.42%	1.36%	11.04%	-0.05%

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

国联中证500ETF累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2019年11月15日-2025年06月30日)



注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为国联基金管理有限公司，成立于2013年5月31日，由国联民生证券股份有限公司与上海融晟投资有限公司共同出资，注册资金7.5亿元人民币。截至2025年6月30日，国联基金管理有限公司共管理90只基金，包括国联货币市场基金、国联国企改革灵活配置混合型证券投资基金、国联新机遇灵活配置混合型证券投资基金、国联新经济灵活配置混合型证券投资基金、国联鑫起点灵活配置混合型证券投资基金、国联产业升级灵活配置混合型证券投资基金、国联盈泽中短债债券型证券投资基金、国联恒泰纯债债券型证券投资基金、国联睿祥纯债债券型证券投资基金、国联上海清算所银行间1-3年中高等级信用债指数发起式证券投资基金、国联竞争优势股票型证券投资基金、国联物联网主题灵活配置混合型证券投资基金、国联现金增利货币市场基金、国联恒信纯债债券型证券投资基金、国联鑫思路灵活配置混合型证券投资基金、国联核心成长灵活配置混合型证券投资基金、国联鑫价值灵活配置混合型证券投资基金、国联智选红利股票型证券投资基金、国联沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金、国联聚商3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联聚业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联季季红定期开放债券型证券投资基金、国联聚安3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联恒裕纯债债券型证券投资基金、国联恒惠纯债债券型证券投资基金、国联聚明3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联高股息精选混合型证券投资基金、国联医疗健康精选混合型证券投资基金、国联策略优选混合型证券投资基金、国联聚汇3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联央视财经50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国联聚通3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联恒鑫纯债债券型证券投资基金、国联中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国联睿嘉39个月定期开放债券型证券投资基金、国联睿享86个月定期开放债券型证券投资基金、国联研发创新混合型证券投资基金、国联品牌优选混合型证券投资基金、国联聚锦一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国联恒安纯债债券型证券投资基金、国联智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、国联价值成长6个月持有期混合型证券投资基金、国联中债1-5年国开行债券指数证券投资基金、国联融慧双欣一年定期开放债券型证券投资基金、国联成长优选混合型证券投资基金、国联景颐6个月持有期混合型证券投资基金、国联行业先锋6个月持有期混合型证券投资基金、国联鑫锐研究精选一年持有期混合型证券投资基金、国联恒阳纯债债券型证券投资基金、国联景盛一年持有期混合型证券投资基金、国联恒益纯债债券型证券投资基金、国联高质量成长混合型证券投资基金、国联景泓一年持有期混合型证券投资基金、国联聚优一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国联低碳经济3个月持有期混合型证券投资基金、国联景惠混合型证券投资基金、国联匠心优选混合型证券投资基金、国联金融鑫选3个月持有期混合型证券投资基金、国联恒利纯债债券型证券投资基金、国联成长先锋一年持有期混合型证券投资基金、国联恒泽纯债债券型证券投资基金、国联优势产业混合型证券投资基金、国联益海30天滚动持有短债债券型证券投资基金、

国联兴鸿优选混合型证券投资基金、国联医药消费混合型证券投资基金、国联融盛双盈债券型证券投资基金、国联益泓90天滚动持有债券型证券投资基金、国联养老目标日期2045三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、国联添安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、国联恒通纯债债券型证券投资基金、国联中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、国联恒润纯债债券型证券投资基金、国联泓安3个月定期开放债券型证券投资基金、国联融誉双华6个月持有期债券型证券投资基金、国联消费精选混合型证券投资基金、国联中债0-3年政策性金融债指数证券投资基金、国联智选先锋股票型证券投资基金、国联益诚30天持有期债券型发起式证券投资基金、国联中证500指数增强型证券投资基金、国联利率债债券型证券投资基金、国联沪深300指数增强型证券投资基金、国联央视财经50交易型开放式指数证券投资基金、国联国证钢铁行业指数型证券投资基金、国联中证煤炭指数型证券投资基金、国联日日盈交易型货币市场基金、国联中证500交易型开放式指数证券投资基金、国联中证A50交易型开放式指数证券投资基金、国联稳健增益债券型证券投资基金、国联上证科创板综合指数增强型证券投资基金、国联中证A50交易型开放式指数证券投资基金联接基金

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈薪羽	国联央视财经50交易型开放式指数证券投资基金、国联央视财经50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国联中证500交易型开放式指数证券投资基金、国联中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国联智选红利股票型证券投资基金、	2019-11-28	-	9	陈薪羽先生，中国国籍，毕业于北京大学概率论与数理统计专业，研究生、硕士学位，具有基金从业资格，证券从业年限9年。2015年8月至2016年10月任中国人保寿险首席投资官秘书。2016年10月加入公司，现任多策略投资部基金经理。

	<p>国联国证钢铁行业指数型证券投资基金、国联中证煤炭指数型证券投资基金、国联景盛一年持有期混合型证券投资基金、国联智选先锋股票型证券投资基金、国联中证500指数增强型证券投资基金的基金经理。</p>				
杜超	<p>国联中证煤炭指数型证券投资基金、国联国证钢铁行业指数型证券投资基金、国联中证500交易型开放式指数证券投资基金、国联中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国联央视财经50交易型开放式指数证券投资基金、国联央视财经50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国联高股息精选混合型证券投资基金、国联新机遇灵活配置混合型证券投资基金、国联中证A50交易型开放式指数证券投资基金、国联中证A50交易型开放</p>	2023-10-20	-	9	<p>杜超先生,中国国籍,毕业于南京航空航天大学计算机科学与技术专业,本科、学士学位,具有基金从业资格,证券从业年限9年。2013年7月至2016年4月任中国银行软件中心开发五部软件工程师。2016年4月加入公司,现任多策略投资部基金经理。</p>

	式指数证券投资基金联接基金的基金经理。				
--	---------------------	--	--	--	--

注：（1）上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写；基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

（2）证券投资基金从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项配套法规、基金合同和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司制定了《公平交易管理办法》并严格执行。公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，在研究、决策、交易执行等各环节，通过制度、流程、技术手段等各方面措施确保了公平对待所管理的投资组合，保证公平交易原则的实现。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生不公平的交易事项。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2025年上半年，中证500指数上涨3.31%，股市场在宏观经济复苏预期、政策红利释放以及外部环境变化的多重因素推动下，整体呈现震荡上行走势，但不同指数与行业板块间表现分化明显。从节奏上看，市场呈“N型”走势：年初至3月中上旬在经济预期修复与政策持续加码带动下震荡上行；4月初受美国关税战外部扰动影响出现调整；随后

在中长期资金稳步入市以及政策工具加速落地的合力推动下，自4月中旬起市场重拾升势，延续至年中。本基金作为一只投资于中证500指数的被动型产品，我们采取完全复制的被动投资策略，运用智能指数投资系统进行精细化管理，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，严格控制本基金的跟踪偏离度和跟踪误差，给投资者提供一个标准化的中证500指数的投资工具。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国联中证500ETF基金份额净值为1.3146元，本报告期内，基金份额净值增长率为4.25%，同期业绩比较基准收益率为3.31%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025年上半年，全球市场并不太平，既有美国关税战的反复拉扯，以伊地缘冲突引发的战争危机，也有年初以deepseek、宇树机器人引领的中国资产重估，还有局部市场中新消费主题下对labubu等IP价值的重新认知。资产定价的信号并不一致，但归结到宏观叙事层面，我们认为有两个大方向，一是中国资产风险偏好提升，一是美国信用脆弱下的全球美元退潮。深究背后原因，实质是世界老格局已打破新格局未形成下科技革命、财政转型、贸易战等因素合力驱动的全球供应链重塑。

当前全球正在经历新一轮技术革命，疫情后通胀中枢上移，全球主要国家正在调整财政模式，美国财政赤字率收敛，中国财政转型进一步加速，与此同时美国想借由贸易战重塑全球供应链格局，这些变化一旦成型，都将被资本市场充分定价。

随着中国资产风险偏好的提升，不管是内资南下还是外资流入，港股成交量翻倍流动性变好，而A股继港股后也逐步转为增量市场，中国资产正在被重新估值。下半年股票市场将继续交易流动性，最重要的是不断寻找新的存在预期差且未来能够形成资金共识的板块。

本基金将积极应对各种因素对指数跟踪效果带来的冲击，努力将跟踪误差控制在基金合同规定的范围内，力争使投资者充分获得指数的长期收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；设立估值委员会，估值委员会成员由具有专业胜任能力和相关工作经历的高级管理人员、投资研究部门、基金运营部门、风险管理部门、法律合规部门人员组成，负责研究、指导基金估值业务，基金经理根据公司制度参加估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务；使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则及具体估值程序；估

值流程中包含风险监测、控制和报告机制。本基金日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。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。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在国联中证500交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《国联中证500交易型开放式指数证券投资基金2025年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国联中证500交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	1,719,961.42	4,847,080.67
结算备付金		948,697.57	765,230.37
存出保证金		713,806.43	567,436.95
交易性金融资产	6.4.7.2	66,083,820.24	69,382,185.86
其中：股票投资		66,063,567.20	69,382,185.86
基金投资		-	-
债券投资		20,253.04	-
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		3,500,361.91	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		72,966,647.57	75,561,933.85
负债和净资产	附注号	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024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		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		16,574.00	22,566.10
应付托管费		5,524.68	7,522.04
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		6,323.33	6,670.68
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	183,463.50	690,486.46
负债合计		211,885.51	727,245.28
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	55,345,700.00	59,345,700.00
未分配利润	6.4.7.8	17,409,062.06	15,488,988.57
净资产合计		72,754,762.06	74,834,688.57
负债和净资产总计		72,966,647.57	75,561,933.85

注：报告截止日2025年06月30日，基金份额总额55,345,700.00份，份额净值1.3146元。

6.2 利润表

会计主体：国联中证500交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025年01月01日至2025年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025年01月01日至 2025年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至202 4年06月30日
一、营业总收入		3,492,895.61	-2,284,541.00
1.利息收入		23,553.68	11,020.25

其中：存款利息收入	6.4.7.9	16,898.66	11,020.25
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		6,655.02	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		233,334.31	-531,945.69
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-491,952.18	-868,131.54
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	1,807.04	-
资产支持证券投资	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	120,939.33	-73,068.76
股利收益	6.4.7.16	602,540.12	409,254.61
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	3,294,835.94	-1,708,608.71
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	-58,828.32	-55,006.85
减：二、营业总支出		219,443.07	77,827.72
1.管理人报酬		103,937.60	47,360.41
2.托管费		34,645.88	15,786.75
3.销售服务费		-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-

6.信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7.税金及附加		548.71	-
8.其他费用	6.4.7.20	80,310.88	14,680.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,273,452.54	-2,362,368.72
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,273,452.54	-2,362,368.72
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		3,273,452.54	-2,362,368.72

6.3 净资产变动表

会计主体：国联中证500交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025年01月01日至2025年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	59,345,700.00	15,488,988.57	74,834,688.57
二、本期期初净资产	59,345,700.00	15,488,988.57	74,834,688.57
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-4,000,000.00	1,920,073.49	-2,079,926.51
（一）、综合收益总额	-	3,273,452.54	3,273,452.54
（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	-4,000,000.00	-1,353,379.05	-5,353,379.05

列)			
其中：1.基金申购款	4,000,000.00	1,140,676.76	5,140,676.76
2.基金赎回款	-8,000,000.00	-2,494,055.81	-10,494,055.81
(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	55,345,700.00	17,409,062.06	72,754,762.06
项目	上年度可比期间		
	2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	25,345,700.00	4,400,946.38	29,746,646.38
二、本期期初净资产	25,345,700.00	4,400,946.38	29,746,646.38
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	4,000,000.00	-1,860,330.01	2,139,669.99
(一)、综合收益总额	-	-2,362,368.72	-2,362,368.72
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	4,000,000.00	502,038.71	4,502,038.71
其中：1.基金申购款	6,000,000.00	729,816.44	6,729,816.44
2.基金赎回款	-2,000,000.00	-227,777.73	-2,227,777.73
(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	29,345,700.00	2,540,616.37	31,886,316.37

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:

王瑶

周妹云

李克

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

国联中证500交易型开放式指数证券投资基金(原名为中融中证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]1304号文《关于准予中融中证500交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》批准,由国联基金管理有限公司(原中融基金管理有限公司)依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《中融中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》("基金合同")负责公开募集,于2019年11月15日募集成立。本基金的基金管理人为国联基金管理有限公司,基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据本基金的基金管理人2023年9月6日发布的《国联基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》本基金自2023年9月8日起更名为国联中证500交易型开放式指数证券投资基金。

本基金募集期为2019年9月3日至2019年11月8日,本基金为交易型开放式基金,存续期限不定,本基金共募集有效净认购资金235,339,130.00元,折合235,339,130.00份国联中证500ETF基金份额。有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币6,570.00元,折合6,570份国联中证500ETF基金份额,以上收到的实收基金共计人民币235,345,700.00元,折合235,345,700份国联中证500ETF基金份额,有效认购户数为3637户。本基金募集资金经上会会计师事务所(特殊普通合伙)验资。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和基金合同等有关规定,本基金主要投资于标的指数即中证500指数成份股和备选成份股。为更好地实现基金的投资目标,本基金还可投资于国内依法发行上市的非成份股(包括中小板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准上市或同意注册的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期

融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券等）、货币市场工具、债券回购、资产支持证券、银行存款、股指期货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）。

本基金业绩比较基准为中证500指数收益率。

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

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2025年06月30日的财务状况以及2025年半年度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

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

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《财政部、国家税务总局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号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、财税[2016]46号文《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号文《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号文《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号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》及其他相关税务法规和实务操作，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日前取得的基金、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基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2、对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

3、证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4、对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5、基金卖出股票缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免于缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末	
	2025年06月30日	
活期存款	1,719,961.42	
等于：本金	1,719,520.97	
加：应计利息	440.45	
减：坏账准备	-	
定期存款	-	
等于：本金	-	
加：应计利息	-	
减：坏账准备	-	
其中：存款期限1个月以内	-	
存款期限1-3个月	-	
存款期限3个月以上	-	
其他存款	-	
等于：本金	-	
加：应计利息	-	
减：坏账准备	-	
合计	1,719,961.42	

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2025年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票		65,982,554.25	-	66,063,567.20	81,012.95
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	17,500.00	7.29	20,253.04	2,745.75
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	17,500.00	7.29	20,253.04	2,745.75
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		66,000,054.25	7.29	66,083,820.24	83,758.70

注：股票投资的公允价值和股票投资的估值增值均包含可退替代款的估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025年06月30日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	5,643,120.00	-	-	-
--股指期货	5,643,120.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	5,643,120.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为零。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益。因此，衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的股指期货暂收暂付款(结算所得的持仓损益)抵销后无余额。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
----	----	----------	------	--------

IC2507	中证500股指期货2 507合约	5.00	5,867,400.00	224,280.00
合计				224,280.00
减：可抵销 期货暂收 款				224,280.00
净额				-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.5 其他资产

注：无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	4,140.57
其中：交易所市场	4,140.57
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	9,916.99
预提费用-信息披露费	39,671.58

应退替代款	129,734.36
合计	183,463.50

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	59,345,700.00	59,345,700.00
本期申购	4,000,000.00	4,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-8,000,000.00	-8,000,000.00
本期末	55,345,700.00	55,345,700.00

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

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	32,482,748.89	-16,993,760.32	15,488,988.57
本期期初	32,482,748.89	-16,993,760.32	15,488,988.57
本期利润	-21,383.40	3,294,835.94	3,273,452.54
本期基金份额交易产生的变动数	-2,190,370.62	836,991.57	-1,353,379.05
其中：基金申购款	2,188,142.75	-1,047,465.99	1,140,676.76
基金赎回款	-4,378,513.37	1,884,457.56	-2,494,055.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	30,270,994.87	-12,861,932.81	17,409,062.06

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
	活期存款利息收入

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	3,956.55
其他	45.27
合计	16,898.66

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-453,653.62
股票投资收益——赎回差价收入	-38,298.56
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	-491,952.18

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
卖出股票成交总额	15,864,417.18
减：卖出股票成本总额	16,302,115.87
减：交易费用	15,954.93
买卖股票差价收入	-453,653.62

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
赎回基金份额对价总额	10,494,055.81
减：现金支付赎回款总额	5,789,284.81

减：赎回股票成本总额	4,743,069.56
减：交易费用	-
赎回差价收入	-38,298.56

6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.11 基金投资收益

注：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 2025年01月01日至2025年06月30日
债券投资收益——利息收入	7.87
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,799.17
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	1,807.04

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 2025年01月01日至2025年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	7,800.06
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	6,000.00
减：应计利息总额	0.58

减：交易费用	0.31
买卖债券差价收入	1,799.17

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

注：无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
期货投资	120,939.33

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
股票投资产生的股利收益	602,540.12
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	602,540.12

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
1.交易性金融资产	2,927,791.27
——股票投资	2,925,045.52
——债券投资	2,745.75

—资产支持证券投资	-
—贵金属投资	-
—其他	-
2.衍生工具	373,368.00
—权证投资	-
—期货投资	373,368.00
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	6,323.33
合计	3,294,835.94

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
基金赎回费收入	-
ETF基金替代损益	-58,828.32
合计	-58,828.32

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

6.4.7.19 信用减值损失

注：无。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
审计费用	9,916.99
信息披露费	39,671.58

证券出借违约金	-
指数使用费	30,722.31
合计	80,310.88

6.4.7.21 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无发生变化的情况。

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
国联基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司	基金托管人
国联民生证券股份有限公司	基金管理人股东
上海融晟投资有限公司	基金管理人股东
国联（北京）资产管理有限公司	基金管理人子公司
国联中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“国联中证500ETF联接”）	基金管理人管理的其他基金

注：（1）根据国联民生证券股份有限公司公告，自2025年2月7日起，公司名称由“国联证券股份有限公司”正式变更为“国联民生证券股份有限公司”。

（2）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

注：无。

6.4.10.1.2 权证交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券交易

注：无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至20 25年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至20 24年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	103,937.60	47,360.41
其中：应支付销售机构的客户维护费	-	-
应支付基金管理人的净管理费	103,937.60	47,360.41

注：①支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值的年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.30%/当年天数。

②客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间

	2025年01月01日至2025年06月30日	2024年01月01日至2024年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	34,645.88	15,786.75

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值的年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值X0.10%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

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：无。

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 2025年06月30日		上年度末 2024年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
国联中证500ETF联接	46,214,100.00	83.50%	52,416,100.00	88.32%

注：（1）除基金管理人之外的其他关联方持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

（2）对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额。

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 2025年01月01日至2025年06月30日		上年度可比期间 2024年01月01日至2024年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

中国光大 银行股份 有限公司	1,719,961.42	12,896.84	2,114,735.57	8,055.14
----------------------	--------------	-----------	--------------	----------

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。本基金用于证券交易结算的资金通过托管人托管结算资金专用存款账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，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：无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

于2025年6月30日，本基金持有9600股股东方国联民生的A股普通股，成本总额为人民币113020.18元，占基金净资产的比率为0.16%。（2024年6月30日，6000股，成本总额为人民币64578.84元，占基金净资产的比率为0.2%。）

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

注：无。

6.4.12 期末（2025年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：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

注：无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过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实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节，构建了分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，形成了由四大防线共同筑成的风险管理体系。本基金管理人的各个业务部门为第一道防线，各业务部门总监作为风险责任人，负责制订本部门的作业流程以及风险控制措施；公司专属风险管理部门法律合规部和风险管理部为第二道防线，负责对公司业务的法律合规风险、投资管理风险和运作风险进行监控管理；公司经营管理层和公司内控及风险管理委员会为第三道防线，负责对风险状况进行全面监督并及时制定相应的对策和实施监控措施；董事会下属的风险与合规委员会为第四道防线，负责审查公司对公司内外部风险识别、评估和分析等情况，及公司内部控制、风险管理政策、风险管理制度的执行情况等。

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的发行人出现违约、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。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的信用评级，通过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。

按信用评级列示的债券、资产支持证券和同业存单的投资情况如下表所示。如无表格，则本基金于本期末及上年度末未持有除国债、地方政府债、政策性金融债、央行票据以外的债券。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：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 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	20,253.04	-
未评级	-	-
合计	20,253.04	-

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、地方政府债、政策性金融债、央行票据。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），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，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注6.4.12.3中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）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因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关于未来现金流的风险。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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025年0 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	1,719,961.42	-	-	-	1,719,961.42
结算备付金	948,697.57	-	-	-	948,697.57
存出保	713,806.43	-	-	-	713,806.43

证金					
交易性金融资产	20,253.04	-	-	66,063,567.20	66,083,820.24
应收清算款	-	-	-	3,500,361.91	3,500,361.91
资产总计	3,402,718.46	-	-	69,563,929.11	72,966,647.57
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	16,574.00	16,574.00
应付托管费	-	-	-	5,524.68	5,524.68
应交税费	-	-	-	6,323.33	6,323.33
其他负债	-	-	-	183,463.50	183,463.50
负债总计	-	-	-	211,885.51	211,885.51
利率敏感度缺口	3,402,718.46	-	-	69,352,043.60	72,754,762.06
上年度末 2024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	4,847,080.67	-	-	-	4,847,080.67
结算备付金	765,230.37	-	-	-	765,230.37
存出保证金	567,436.95	-	-	-	567,436.95
交易性金融资	-	-	-	69,382,185.86	69,382,185.86

产					
资产总计	6,179,747.99	-	-	69,382,185.86	75,561,933.85
负债					
应付清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	22,566.10	22,566.10
应付托管费	-	-	-	7,522.04	7,522.04
应交税费	-	-	-	6,670.68	6,670.68
其他负债	-	-	-	690,486.46	690,486.46
负债总计	-	-	-	727,245.28	727,245.28
利率敏感度缺口	6,179,747.99	-	-	68,654,940.58	74,834,688.57

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的情况下，利率发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值可参考的公允价值产生的影响。本基金于本报告期末及上年度末未持有债券投资或持有的债券投资占比并不重大，因而市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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。本基金主要投资于上市交易的证券，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。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

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 2025年06月30日		上年度末 2024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	66,063,567.20	90.80	69,382,185.86	92.71
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	20,253.04	0.03	-	-
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	66,083,820.24	90.83	69,382,185.86	92.71

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、估测组合市场价格风险的敏感性为考察沪深300指数变动时，因股票资产变动导致对基金资产净值的影响金额；
	2、假定沪深300指数变化5%，其他市场变量不变；
	3、Beta系数是根据组合在过去一年的净值数据和沪深300指数数据回归得出，对于成立不足一年的组合，取自成立以来的数据计算。

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 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
	沪深300指数上升5%	4,120,984.31	4,371,657.64
沪深300指数下降5%	-4,120,984.31	-4,371,657.64	

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，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。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

本基金以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债，其公允价值计量基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，被划分为三个层次：

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次输入值是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。

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	66,083,820.24	69,382,185.86
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	66,083,820.24	69,382,185.86

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§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	66,063,567.20	90.54
	其中：股票	66,063,567.20	90.54
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	20,253.04	0.03
	其中：债券	20,253.04	0.03
	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	2,668,658.99	3.66
8	其他各项资产	4,214,168.34	5.78
9	合计	72,966,647.57	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	167,834.00	0.23
B	采矿业	2,412,054.50	3.32
C	制造业	41,832,980.98	57.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,895,527.80	2.61
E	建筑业	589,146.00	0.81
F	批发和零售业	1,461,863.02	2.01
G	交通运输、仓储和邮政业	1,010,518.47	1.39
H	住宿和餐饮业	180,441.00	0.25
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,216,040.19	8.54
J	金融业	6,594,273.80	9.06
K	房地产业	833,148.76	1.15
L	租赁和商务服务业	581,892.60	0.80
M	科学研究和技术服务业	451,346.00	0.62
N	水利、环境和公共设施管理业	282,597.60	0.39
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	138,924.00	0.19
Q	卫生和社会工作	309,399.48	0.43
R	文化、体育和娱乐业	945,085.00	1.30
S	综合	160,494.00	0.22
	合计	66,063,567.20	90.80

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：本基金本报告期末未持有积极股票投资。

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：本基金本报告期末未持有港股股票。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300476	胜宏科技	5,500	739,090.00	1.02
2	000988	华工科技	9,300	437,193.00	0.60
3	600988	赤峰黄金	15,300	380,664.00	0.52
4	300339	润和软件	7,300	371,059.00	0.51
5	002966	苏州银行	41,090	360,770.20	0.50
6	600839	四川长虹	33,900	329,508.00	0.45
7	601555	东吴证券	36,500	319,375.00	0.44
8	688521	芯原股份	3,300	318,450.00	0.44
9	601162	天风证券	63,800	314,534.00	0.43
10	002517	恺英网络	15,700	303,167.00	0.42
11	002340	格林美	47,100	299,085.00	0.41
12	002195	岩山科技	52,300	294,449.00	0.40
13	002558	巨人网络	12,400	292,020.00	0.40
14	603893	瑞芯微	1,900	288,534.00	0.40
15	002261	拓维信息	9,200	284,740.00	0.39
16	002156	通富微电	11,100	284,382.00	0.39
17	600487	亨通光电	18,100	276,930.00	0.38
18	002797	第一创业	38,700	273,996.00	0.38
19	300251	光线传媒	13,400	271,618.00	0.37

20	300207	欣旺达	13,500	270,810.00	0.37
21	000066	中国长城	17,800	263,440.00	0.36
22	600096	云天化	11,700	257,049.00	0.35
23	688777	中控技术	5,700	255,987.00	0.35
24	002273	水晶光电	12,800	255,616.00	0.35
25	601168	西部矿业	15,300	254,439.00	0.35
26	002465	海格通信	18,200	253,708.00	0.35
27	600879	航天电子	24,200	253,374.00	0.35
28	600536	中国软件	5,379	251,575.83	0.35
29	300450	先导智能	10,100	250,985.00	0.34
30	300803	指南针	3,080	248,432.80	0.34
31	000831	中国稀土	6,800	245,616.00	0.34
32	688608	恒玄科技	700	243,586.00	0.33
33	600352	浙江龙盛	23,900	242,824.00	0.33
34	002294	信立泰	5,100	241,383.00	0.33
35	000933	神火股份	14,500	241,280.00	0.33
36	300017	网宿科技	22,500	241,200.00	0.33
37	688002	睿创微纳	3,458	241,091.76	0.33
38	600885	宏发股份	10,692	238,538.52	0.33
39	002185	华天科技	23,500	237,350.00	0.33
40	601099	太平洋	60,300	236,979.00	0.33
41	601108	财通证券	29,900	236,509.00	0.33
42	688120	华海清科	1,396	235,505.20	0.32
43	688213	思特威	2,300	235,106.00	0.32
44	688235	百济神州	1,000	233,640.00	0.32
45	688099	晶晨股份	3,216	228,368.16	0.31
46	002130	沃尔核材	9,300	221,526.00	0.30
47	601577	长沙银行	22,200	220,668.00	0.30
48	600079	人福医药	10,500	220,290.00	0.30
49	688122	西部超导	4,200	217,896.00	0.30
50	688469	芯联集成	45,600	217,512.00	0.30

51	002281	光迅科技	4,400	217,008.00	0.30
52	300454	深信服	2,300	216,614.00	0.30
53	601128	常熟银行	29,360	216,383.20	0.30
54	002085	万丰奥威	13,600	216,104.00	0.30
55	000423	东阿阿胶	4,100	214,430.00	0.29
56	000997	新大陆	6,600	213,708.00	0.29
57	300058	蓝色光标	32,560	213,593.60	0.29
58	002532	天山铝业	25,700	213,567.00	0.29
59	002738	中矿资源	6,640	213,542.40	0.29
60	002595	豪迈科技	3,600	213,192.00	0.29
61	300002	神州泰岳	18,000	212,400.00	0.29
62	000783	长江证券	30,500	211,365.00	0.29
63	688617	惠泰医疗	711	211,167.00	0.29
64	300458	全志科技	5,300	210,357.00	0.29
65	600109	国金证券	23,900	209,603.00	0.29
66	002138	顺络电子	7,400	208,088.00	0.29
67	002472	双环传动	6,200	207,638.00	0.29
68	300223	北京君正	3,000	207,600.00	0.29
69	002078	太阳纸业	15,400	207,284.00	0.28
70	603596	伯特利	3,900	205,491.00	0.28
71	002436	兴森科技	15,500	205,220.00	0.28
72	300474	景嘉微	2,800	204,400.00	0.28
73	601933	永辉超市	41,700	204,330.00	0.28
74	002410	广联达	15,200	203,832.00	0.28
75	300765	新诺威	3,900	201,591.00	0.28
76	600862	中航高科	7,700	200,816.00	0.28
77	002851	麦格米特	4,000	200,560.00	0.28
78	600143	金发科技	19,400	200,014.00	0.27
79	300346	南大光电	6,300	199,332.00	0.27
80	601198	东兴证券	17,800	198,470.00	0.27
81	300054	鼎龙股份	6,900	197,892.00	0.27

82	002065	东华软件	20,600	197,760.00	0.27
83	300136	信维通信	8,800	197,120.00	0.27
84	600580	卧龙电驱	9,960	196,909.20	0.27
85	002353	杰瑞股份	5,600	196,000.00	0.27
86	300024	机器人	11,400	195,852.00	0.27
87	002223	鱼跃医疗	5,500	195,800.00	0.27
88	000034	神州数码	5,200	195,728.00	0.27
89	600873	梅花生物	18,300	195,627.00	0.27
90	603129	春风动力	900	194,850.00	0.27
91	002202	金风科技	19,000	194,750.00	0.27
92	002673	西部证券	24,700	194,636.00	0.27
93	600363	联创光电	3,300	192,489.00	0.26
94	002850	科达利	1,700	192,389.00	0.26
95	603606	东方电缆	3,700	191,327.00	0.26
96	601615	明阳智能	16,600	190,734.00	0.26
97	002624	完美世界	12,500	189,625.00	0.26
98	000728	国元证券	24,000	189,360.00	0.26
99	300857	协创数据	2,200	189,332.00	0.26
100	300395	菲利华	3,700	189,070.00	0.26
101	300496	中科创达	3,300	188,826.00	0.26
102	300383	光环新网	13,200	188,760.00	0.26
103	688525	佰维存储	2,800	188,720.00	0.26
104	002008	大族激光	7,700	187,649.00	0.26
105	000021	深科技	10,000	187,400.00	0.26
106	600298	安琪酵母	5,300	186,401.00	0.26
107	300115	长盈精密	8,700	186,180.00	0.26
108	300604	长川科技	4,100	184,131.00	0.25
109	603659	璞泰来	9,800	184,044.00	0.25
110	600895	张江高科	7,100	182,470.00	0.25
111	600549	厦门钨业	8,700	182,004.00	0.25
112	300012	华测检测	15,500	181,195.00	0.25

113	000426	兴业银锡	11,400	180,120.00	0.25
114	002155	湖南黄金	10,030	179,035.50	0.25
115	600171	上海贝岭	5,200	178,100.00	0.24
116	603160	汇顶科技	2,500	177,575.00	0.24
117	688578	艾力斯	1,900	176,776.00	0.24
118	603087	甘李药业	3,200	175,296.00	0.24
119	000733	振华科技	3,500	175,175.00	0.24
120	603605	珀莱雅	2,100	173,859.00	0.24
121	300627	华测导航	4,960	173,600.00	0.24
122	688220	翱捷科技	2,200	172,260.00	0.24
123	601216	君正集团	31,000	171,120.00	0.24
124	600392	盛和资源	12,900	169,893.00	0.23
125	601665	齐鲁银行	26,800	169,376.00	0.23
126	000750	国海证券	41,100	169,332.00	0.23
127	605589	圣泉集团	6,100	169,275.00	0.23
128	300699	光威复材	5,340	169,117.80	0.23
129	688072	拓荆科技	1,100	169,081.00	0.23
130	300037	新宙邦	4,800	168,960.00	0.23
131	002444	巨星科技	6,600	168,366.00	0.23
132	000932	华菱钢铁	38,200	168,080.00	0.23
133	601997	贵阳银行	26,800	167,232.00	0.23
134	000729	燕京啤酒	12,900	166,797.00	0.23
135	300003	乐普医疗	12,100	166,738.00	0.23
136	000519	中兵红箭	7,600	166,364.00	0.23
137	600153	建发股份	16,000	165,920.00	0.23
138	600060	海信视像	7,200	165,744.00	0.23
139	601717	中创智领	9,900	164,538.00	0.23
140	601233	桐昆股份	15,500	164,300.00	0.23
141	000878	云南铜业	12,900	164,088.00	0.23
142	601990	南京证券	20,300	164,024.00	0.23
143	601696	中银证券	15,300	163,557.00	0.22

144	688180	君实生物	4,800	163,104.00	0.22
145	300001	特锐德	6,800	162,996.00	0.22
146	300142	沃森生物	14,700	161,700.00	0.22
147	002414	高德红外	15,700	160,925.00	0.22
148	600673	东阳光	13,800	160,494.00	0.22
149	688065	凯赛生物	3,400	160,140.00	0.22
150	688361	中科飞测	1,900	159,961.00	0.22
151	600369	西南证券	36,700	159,645.00	0.22
152	002821	凯莱英	1,800	158,850.00	0.22
153	600699	均胜电子	9,100	158,704.00	0.22
154	002007	华兰生物	10,100	158,267.00	0.22
155	300073	当升科技	3,600	157,932.00	0.22
156	603979	金诚信	3,400	157,896.00	0.22
157	002837	英维克	5,300	157,463.00	0.22
158	688052	纳芯微	900	157,041.00	0.22
159	600177	雅戈尔	21,200	154,760.00	0.21
160	600521	华海药业	8,300	154,629.00	0.21
161	600118	中国卫星	5,400	154,278.00	0.21
162	600398	海澜之家	22,100	153,816.00	0.21
163	000893	亚钾国际	5,100	153,714.00	0.21
164	603345	安井食品	1,900	152,798.00	0.21
165	002152	广电运通	11,300	151,872.00	0.21
166	600316	洪都航空	4,000	150,800.00	0.21
167	600704	物产中大	28,600	150,722.00	0.21
168	300373	扬杰科技	2,900	150,510.00	0.21
169	600909	华安证券	25,800	150,414.00	0.21
170	000738	航发控制	7,242	150,271.50	0.21
171	688249	晶合集成	7,400	149,998.00	0.21
172	300748	金力永磁	6,240	148,761.60	0.20
173	600497	驰宏锌锗	28,100	148,649.00	0.20
174	002044	美年健康	28,800	148,032.00	0.20

175	002958	青农商行	40,900	147,649.00	0.20
176	000623	吉林敖东	8,700	147,465.00	0.20
177	000009	中国宝安	16,500	146,520.00	0.20
178	600141	兴发集团	7,100	145,763.00	0.20
179	603179	新泉股份	3,100	145,607.00	0.20
180	002318	久立特材	6,200	145,018.00	0.20
181	600435	北方导航	9,300	144,987.00	0.20
182	600765	中航重机	8,580	144,830.40	0.20
183	688188	柏楚电子	1,092	143,772.72	0.20
184	000400	许继电气	6,600	143,682.00	0.20
185	600038	中直股份	3,700	143,597.00	0.20
186	000528	柳工	14,900	143,189.00	0.20
187	688385	复旦微电	2,900	142,883.00	0.20
188	002683	广东宏大	4,200	142,548.00	0.20
189	002409	雅克科技	2,600	142,194.00	0.20
190	600155	华创云信	20,400	141,984.00	0.20
191	600562	国睿科技	4,500	141,705.00	0.19
192	300919	中伟股份	4,300	141,384.00	0.19
193	603228	景旺电子	3,340	139,745.60	0.19
194	000960	锡业股份	9,100	139,230.00	0.19
195	001696	宗申动力	6,200	139,190.00	0.19
196	002607	中公教育	45,400	138,924.00	0.19
197	600637	东方明珠	18,500	138,195.00	0.19
198	688027	国盾量子	500	137,505.00	0.19
199	600884	杉杉股份	14,500	137,170.00	0.19
200	300623	捷捷微电	4,600	137,080.00	0.19
201	600498	烽火通信	6,500	136,695.00	0.19
202	300724	捷佳伟创	2,500	135,750.00	0.19
203	002739	万达电影	11,700	133,731.00	0.18
204	000039	中集集团	17,000	133,620.00	0.18
205	300558	贝达药业	2,300	133,285.00	0.18

206	688568	中科星图	3,700	133,237.00	0.18
207	600529	山东药玻	6,000	132,840.00	0.18
208	000415	渤海租赁	39,800	132,534.00	0.18
209	002841	视源股份	3,800	131,480.00	0.18
210	301358	湖南裕能	4,200	130,998.00	0.18
211	600486	扬农化工	2,240	129,920.00	0.18
212	002926	华西证券	14,500	129,630.00	0.18
213	603939	益丰药房	5,296	129,593.12	0.18
214	600901	江苏金租	21,260	128,835.60	0.18
215	002025	航天电器	2,500	128,525.00	0.18
216	002385	大北农	31,600	127,664.00	0.18
217	002653	海思科	3,000	126,660.00	0.17
218	300285	国瓷材料	7,300	126,655.00	0.17
219	000887	中鼎股份	7,200	126,648.00	0.17
220	300763	锦浪科技	2,200	126,258.00	0.17
221	688017	绿的谐波	1,000	124,890.00	0.17
222	002939	长城证券	14,800	124,024.00	0.17
223	300144	宋城演艺	14,500	123,975.00	0.17
224	600820	隧道股份	20,200	123,220.00	0.17
225	002568	百润股份	4,800	122,928.00	0.17
226	300679	电连技术	2,700	122,526.00	0.17
227	600008	首创环保	40,510	122,340.20	0.17
228	603486	科沃斯	2,100	122,283.00	0.17
229	000723	美锦能源	28,300	122,256.00	0.17
230	600132	重庆啤酒	2,200	121,220.00	0.17
231	600390	五矿资本	20,700	120,681.00	0.17
232	002064	华峰化学	18,200	120,302.00	0.17
233	600516	方大炭素	25,900	120,176.00	0.17
234	600563	法拉电子	1,100	119,999.00	0.16
235	300757	罗博特科	800	119,976.00	0.16
236	600863	内蒙华电	29,100	119,601.00	0.16

237	002312	川发龙蟒	10,400	119,392.00	0.16
238	002080	中材科技	6,100	118,950.00	0.16
239	000513	丽珠集团	3,300	118,932.00	0.16
240	688538	和辉光电	50,800	118,872.00	0.16
241	000703	恒逸石化	20,200	118,776.00	0.16
242	603568	伟明环保	6,220	118,677.60	0.16
243	600166	福田汽车	43,700	118,427.00	0.16
244	600763	通策医疗	2,841	117,276.48	0.16
245	600208	衢州发展	39,100	115,736.00	0.16
246	002500	山西证券	19,800	115,632.00	0.16
247	601179	中国西电	18,800	115,432.00	0.16
248	600312	平高电气	7,500	115,425.00	0.16
249	603816	顾家家居	4,500	114,840.00	0.16
250	000683	博源化工	23,900	114,481.00	0.16
251	300676	华大基因	2,300	114,471.00	0.16
252	002262	恩华药业	5,500	114,290.00	0.16
253	600998	九州通	22,235	114,287.90	0.16
254	688582	芯动联科	1,700	114,240.00	0.16
255	605358	立昂微	4,900	114,170.00	0.16
256	601155	新城控股	8,300	113,544.00	0.16
257	002203	海亮股份	11,000	113,520.00	0.16
258	600021	上海电力	12,900	113,391.00	0.16
259	300487	蓝晓科技	2,250	113,175.00	0.16
260	600170	上海建工	47,200	112,808.00	0.16
261	688183	生益电子	2,200	112,640.00	0.15
262	600985	淮北矿业	9,900	112,266.00	0.15
263	600126	杭钢股份	12,400	111,600.00	0.15
264	603589	口子窖	3,200	111,360.00	0.15
265	002244	滨江集团	11,400	111,150.00	0.15
266	601000	唐山港	27,300	110,838.00	0.15
266	600583	海油工程	20,300	110,838.00	0.15

267	000591	太阳能	25,200	110,628.00	0.15
268	600380	健康元	10,000	110,300.00	0.15
269	600348	华阳股份	16,550	110,223.00	0.15
270	688114	华大智造	1,700	110,211.00	0.15
271	000060	中金岭南	24,000	109,920.00	0.15
272	000629	钒钛股份	42,800	109,568.00	0.15
273	688728	格科微	7,100	109,340.00	0.15
274	002432	九安医疗	3,000	109,290.00	0.15
275	300567	精测电子	1,800	109,098.00	0.15
276	603338	浙江鼎力	2,300	109,020.00	0.15
277	000403	派林生物	6,010	108,961.30	0.15
278	603379	三美股份	2,260	108,751.20	0.15
279	601991	大唐发电	34,200	108,414.00	0.15
280	600872	中炬高新	5,700	108,300.00	0.15
281	000830	鲁西化工	10,500	108,150.00	0.15
282	600535	天士力	6,900	107,985.00	0.15
283	000921	海信家电	4,200	107,940.00	0.15
284	603885	吉祥航空	8,000	107,760.00	0.15
285	002603	以岭药业	7,600	107,160.00	0.15
286	002439	启明星辰	6,700	107,133.00	0.15
287	002984	森麒麟	5,700	106,875.00	0.15
288	600816	建元信托	36,200	106,790.00	0.15
289	002056	横店东磁	7,500	106,125.00	0.15
290	300146	汤臣倍健	9,400	105,656.00	0.15
291	000062	深圳华强	3,900	104,754.00	0.14
292	600970	中材国际	12,100	103,818.00	0.14
293	601016	节能风电	35,720	103,230.80	0.14
294	603927	中科软	5,336	103,198.24	0.14
295	600499	科达制造	10,500	102,900.00	0.14
296	002423	中粮资本	8,400	102,732.00	0.14
297	000958	电投产融	14,900	101,916.00	0.14

298	300390	天华新能	5,340	101,833.80	0.14
299	000636	风华高科	7,400	101,676.00	0.14
300	600095	湘财股份	10,100	101,303.00	0.14
301	601611	中国核建	11,000	101,090.00	0.14
302	603000	人民网	5,000	101,050.00	0.14
303	000563	陕国投A	28,240	100,816.80	0.14
304	601666	平煤股份	13,600	100,776.00	0.14
305	600685	中船防务	3,700	100,603.00	0.14
306	603298	杭叉集团	4,800	100,560.00	0.14
307	300212	易华录	4,620	100,531.20	0.14
308	000155	川能动力	10,200	100,164.00	0.14
309	600859	王府井	7,200	100,008.00	0.14
310	300677	英科医疗	4,200	99,456.00	0.14
311	601456	国联民生	9,600	99,360.00	0.14
312	600655	豫园股份	17,900	99,345.00	0.14
313	600511	国药股份	3,400	99,144.00	0.14
314	603077	和邦生物	56,500	98,875.00	0.14
315	000598	兴蓉环境	13,700	98,777.00	0.14
316	600325	华发股份	20,248	98,607.76	0.14
317	600483	福能股份	10,200	98,328.00	0.14
318	601966	玲珑轮胎	6,700	98,289.00	0.14
319	600004	白云机场	10,800	98,280.00	0.14
320	600131	国网信通	5,500	97,350.00	0.13
321	603156	养元饮品	4,600	97,336.00	0.13
322	601958	金钼股份	8,800	96,272.00	0.13
323	301308	江波龙	1,100	96,239.00	0.13
324	600663	陆家嘴	10,800	95,688.00	0.13
325	603899	晨光股份	3,300	95,667.00	0.13
326	002773	康弘药业	3,300	95,601.00	0.13
327	000050	深天马A	11,200	95,424.00	0.13
328	600282	南钢股份	22,700	95,340.00	0.13

329	002507	涪陵榨菜	7,440	95,157.60	0.13
330	000951	中国重汽	5,400	94,932.00	0.13
331	300529	健帆生物	4,400	94,908.00	0.13
332	600378	昊华科技	3,500	94,745.00	0.13
333	000987	越秀资本	13,770	94,462.20	0.13
334	600754	锦江酒店	4,200	94,248.00	0.13
334	600271	航天信息	10,200	94,248.00	0.13
335	601001	晋控煤业	7,700	94,094.00	0.13
336	688278	特宝生物	1,300	93,743.00	0.13
337	600598	北大荒	6,500	93,730.00	0.13
338	603737	三棵树	2,536	93,451.60	0.13
339	000559	万向钱潮	12,200	93,330.00	0.13
340	300601	康泰生物	6,100	92,659.00	0.13
341	600737	中粮糖业	9,800	92,610.00	0.13
342	600739	辽宁成大	8,400	92,400.00	0.13
343	601918	新集能源	14,300	92,378.00	0.13
344	002756	永兴材料	2,900	92,075.00	0.13
345	002429	兆驰股份	20,800	91,104.00	0.13
346	600582	天地科技	15,200	91,048.00	0.13
347	688297	中无人机	1,700	90,780.00	0.12
348	300070	碧水源	20,000	90,000.00	0.12
349	688520	神州细胞	1,500	89,775.00	0.12
350	601866	中远海发	36,201	89,416.47	0.12
351	002120	韵达股份	13,300	89,110.00	0.12
352	688772	珠海冠宇	6,200	88,598.00	0.12
353	600867	通化东宝	10,800	88,560.00	0.12
354	600764	中国海防	2,600	88,400.00	0.12
355	300888	稳健医疗	2,140	87,954.00	0.12
356	601231	环旭电子	6,000	87,780.00	0.12
357	002430	杭氧股份	4,500	87,390.00	0.12
358	600566	济川药业	3,300	86,889.00	0.12

359	600329	达仁堂	2,600	86,736.00	0.12
360	601333	广深铁路	30,000	86,700.00	0.12
361	601098	中南传媒	6,600	86,592.00	0.12
362	003031	中瓷电子	1,620	86,200.20	0.12
363	600258	首旅酒店	6,100	86,193.00	0.12
364	601212	白银有色	27,300	85,449.00	0.12
365	300735	光弘科技	3,400	85,340.00	0.12
366	600707	彩虹股份	13,200	85,272.00	0.12
367	000032	深桑达A	4,200	84,966.00	0.12
368	301536	星宸科技	1,400	84,420.00	0.12
369	300751	迈为股份	1,200	83,472.00	0.11
370	688301	奕瑞科技	952	83,404.72	0.11
371	000027	深圳能源	13,060	83,322.80	0.11
372	603688	石英股份	2,350	82,767.00	0.11
373	600578	京能电力	18,400	82,616.00	0.11
374	000709	河钢股份	38,100	82,296.00	0.11
375	688363	华熙生物	1,600	82,160.00	0.11
376	600995	南网储能	8,400	82,152.00	0.11
377	688234	天岳先进	1,400	81,970.00	0.11
378	002508	老板电器	4,300	81,743.00	0.11
379	002299	圣农发展	5,700	81,453.00	0.11
380	000967	盈峰环境	11,700	81,315.00	0.11
381	603290	斯达半导	1,000	81,270.00	0.11
382	603341	龙旗科技	2,000	81,260.00	0.11
383	603858	步长制药	5,000	81,200.00	0.11
384	600906	财达证券	11,900	81,158.00	0.11
385	000883	湖北能源	17,900	80,729.00	0.11
386	603728	鸣志电器	1,400	80,458.00	0.11
387	688676	金盘科技	2,400	80,280.00	0.11
388	600517	国网英大	15,700	80,070.00	0.11
389	601399	国机重装	26,500	79,500.00	0.11

390	600546	山煤国际	9,100	79,443.00	0.11
391	603529	爱玛科技	2,300	79,120.00	0.11
391	600959	江苏有线	23,000	79,120.00	0.11
392	600848	上海临港	8,700	78,909.00	0.11
393	688778	厦钨新能	1,400	78,288.00	0.11
394	601928	凤凰传媒	7,000	78,190.00	0.11
395	688561	奇安信	2,300	78,154.00	0.11
396	002831	裕同科技	3,300	77,286.00	0.11
397	002670	国盛金控	5,100	76,755.00	0.11
398	301498	乖宝宠物	700	76,559.00	0.11
399	600968	海油发展	18,700	76,296.00	0.10
400	600808	马钢股份	22,100	76,245.00	0.10
401	000825	太钢不锈	21,000	75,390.00	0.10
402	300595	欧普康视	4,900	74,823.00	0.10
403	300573	兴齐眼药	1,440	74,577.60	0.10
404	002572	索菲亚	5,300	74,253.00	0.10
405	000739	普洛药业	5,300	74,200.00	0.10
406	601636	旗滨集团	14,800	74,148.00	0.10
407	601118	海南橡胶	15,700	74,104.00	0.10
408	600977	中国电影	6,900	73,968.00	0.10
409	002266	浙富控股	24,000	73,920.00	0.10
410	601608	中信重工	16,900	73,853.00	0.10
411	603565	中谷物流	7,700	73,535.00	0.10
412	603225	新凤鸣	6,900	73,485.00	0.10
413	301301	川宁生物	6,100	73,444.00	0.10
414	601156	东航物流	5,600	73,304.00	0.10
415	000543	皖能电力	10,400	72,800.00	0.10
416	600871	石化油服	37,300	72,735.00	0.10
417	600528	中铁工业	9,800	72,324.00	0.10
418	688387	信科移动	12,600	71,190.00	0.10
419	300957	贝泰妮	1,600	70,752.00	0.10

420	603650	彤程新材	2,200	70,730.00	0.10
421	601106	中国一重	25,200	70,560.00	0.10
422	000582	北部湾港	8,500	70,125.00	0.10
423	601598	中国外运	14,200	70,006.00	0.10
424	600801	华新水泥	5,900	69,856.00	0.10
425	000785	居然智家	22,900	69,845.00	0.10
426	600062	华润双鹤	3,700	69,042.00	0.09
427	688318	财富趋势	600	68,952.00	0.09
428	600056	中国医药	6,600	68,244.00	0.09
429	600925	苏能股份	12,600	65,898.00	0.09
430	002153	石基信息	7,544	65,331.04	0.09
431	600373	中文传媒	6,300	64,701.00	0.09
432	603233	大参林	3,960	64,548.00	0.09
433	000429	粤高速A	4,800	63,984.00	0.09
434	601965	中国汽研	3,600	63,900.00	0.09
435	000537	中绿电	7,600	63,536.00	0.09
436	600606	绿地控股	38,800	63,244.00	0.09
437	688563	航材股份	1,100	62,293.00	0.09
438	688702	盛科通信	1,000	61,080.00	0.08
439	601568	北元集团	14,640	60,756.00	0.08
440	600098	广州发展	9,700	60,625.00	0.08
441	688425	铁建重工	14,800	60,384.00	0.08
442	002372	伟星新材	5,800	60,088.00	0.08
443	001286	陕西能源	6,900	60,030.00	0.08
444	603658	安图生物	1,600	60,000.00	0.08
445	600361	创新新材	14,800	59,052.00	0.08
446	688281	华秦科技	956	57,847.56	0.08
447	600688	上海石化	20,200	57,570.00	0.08
448	003022	联泓新科	3,600	56,988.00	0.08
449	000937	冀中能源	9,700	55,775.00	0.08
450	600612	老凤祥	1,100	54,725.00	0.08

451	601019	山东出版	5,700	53,979.00	0.07
452	000898	鞍钢股份	21,900	50,808.00	0.07
453	002608	江苏国信	6,900	50,577.00	0.07
454	600339	中油工程	15,400	50,358.00	0.07
455	601139	深圳燃气	7,900	50,244.00	0.07
456	600032	浙江新能	6,600	49,896.00	0.07
457	688349	三一重能	2,000	49,880.00	0.07
458	688032	禾迈股份	498	49,730.28	0.07
459	301165	锐捷网络	800	49,168.00	0.07
460	000959	首钢股份	14,300	48,620.00	0.07
461	600928	西安银行	12,300	48,216.00	0.07
462	688100	威胜信息	1,300	48,165.00	0.07
463	600720	中交设计	6,200	47,926.00	0.07
464	003035	南网能源	10,400	47,736.00	0.07
465	603707	健友股份	4,268	47,588.20	0.07
466	600295	鄂尔多斯	5,400	47,034.00	0.06
467	002461	珠江啤酒	4,100	46,289.00	0.06
468	603556	海兴电力	1,800	45,846.00	0.06
469	601228	广州港	13,800	44,574.00	0.06
470	301267	华夏眼科	2,300	44,091.00	0.06
471	688248	南网科技	1,400	44,044.00	0.06
472	688375	国博电子	698	41,886.98	0.06
473	688475	萤石网络	1,300	40,976.00	0.06
474	688172	燕东微	2,000	39,320.00	0.05
475	002563	森马服饰	7,400	38,924.00	0.05
476	603786	科博达	700	38,787.00	0.05
477	601061	中信金属	4,900	38,759.00	0.05
478	600927	永安期货	2,600	38,506.00	0.05
479	600007	中国国贸	1,800	37,044.00	0.05
480	000539	粤电力A	8,100	36,774.00	0.05
481	603826	坤彩科技	1,780	34,834.60	0.05

482	600299	安迪苏	3,600	34,740.00	0.05
483	300140	节能环境	5,600	34,552.00	0.05
484	002945	华林证券	2,400	34,488.00	0.05
485	601921	浙版传媒	4,100	33,046.00	0.05
486	001213	中铁特货	8,100	32,886.00	0.05
487	688819	天能股份	1,086	30,147.36	0.04
488	601858	中国科传	1,300	25,285.00	0.03
489	688153	唯捷创芯	800	24,808.00	0.03
490	601158	重庆水务	5,300	24,592.00	0.03
491	600956	新天绿能	2,700	20,844.00	0.03
492	688295	中复神鹰	900	18,720.00	0.03
493	001389	广合科技	300	17,631.00	0.02
494	603868	飞科电器	400	14,348.00	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：本基金本报告期末未持有积极股票投资。

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	688235	百济神州	261,221.04	0.35
2	688608	恒玄科技	259,348.75	0.35
3	000933	神火股份	243,109.00	0.32
4	300450	先导智能	231,112.00	0.31
5	002130	沃尔核材	217,735.00	0.29
6	300454	深信服	208,982.00	0.28
7	300458	全志科技	207,912.00	0.28
8	600363	联创光电	206,406.00	0.28
9	300346	南大光电	196,358.00	0.26

10	002851	麦格米特	192,531.00	0.26
11	300115	长盈精密	184,381.00	0.25
12	300857	协创数据	180,860.00	0.24
13	600171	上海贝岭	166,927.00	0.22
14	002007	华兰生物	161,980.00	0.22
15	605589	圣泉集团	160,844.00	0.21
16	300627	华测导航	158,491.00	0.21
17	603659	璞泰来	152,638.00	0.20
18	002837	英维克	150,094.00	0.20
19	000528	柳工	144,802.00	0.19
20	688027	国盾量子	137,400.00	0.18

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600418	江淮汽车	653,957.00	0.87
2	002625	光启技术	598,974.00	0.80
3	002384	东山精密	457,895.00	0.61
4	600157	永泰能源	371,035.00	0.50
5	301236	软通动力	311,184.00	0.42
6	300866	安克创新	256,479.00	0.34
7	302132	中航成飞	245,870.00	0.33
8	688047	龙芯中科	237,906.64	0.32
9	002128	电投能源	215,621.00	0.29
10	600642	申能股份	150,988.00	0.20
11	688536	思瑞浦	145,504.96	0.19
12	601567	三星医疗	138,185.00	0.18

13	002407	多氟多	138,000.80	0.18
14	601880	辽港股份	133,161.00	0.18
15	603444	吉比特	129,842.00	0.17
16	000818	航锦科技	127,917.00	0.17
17	688331	荣昌生物	119,719.24	0.16
18	002487	大金重工	118,869.00	0.16
19	002202	金风科技	108,448.00	0.14
20	002368	太极股份	107,412.60	0.14

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	12,746,585.85
卖出股票收入（成交）总额	15,864,417.18

注：“买入股票成本总额”和“卖出股票收入总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	20,253.04	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	20,253.04	0.03

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	127108	太能转债	175	20,253.04	0.03

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 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型基金,主要投资标的为指数成份股和备选成份股。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金投资于标的指数为基础资产的股指期货,目的在于满足基金日常投资管理需要,更有效地进行流动性管理,实现跟踪标的指数的投资目标。

本基金投资于股指期货,对基金总体风险的影响很小,并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**

无。

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 报告期内基金投资的前十名证券除赤峰吉隆黄金矿业股份有限公司,苏州银行股份有限公司,东吴证券股份有限公司外其他证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

内蒙古证监局2025年03月21日对赤峰吉隆黄金矿业股份有限公司进行处罚(内蒙古证监局[2025]10号)。江苏证监局2025年04月09日对苏州银行股份有限公司进行处罚(江苏证监局[2025]52号)。国家金融监督管理总局江苏监管局2024年07月31日对苏州银行股份有限公司进行处罚(苏金罚决字[2024]41号)。中国证监会2025年01月02日对东吴证券股份有限公司进行处罚(中国证监会[2025]1号)。中国证监会2024年11月09日对东吴证券股份有限公司进行处罚(处罚字[2024]163号)。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外,本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票未超过基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	713,806.43
2	应收清算款	3,500,361.91
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,214,168.34

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

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:本基金本报告期末未持有积极股票投资。

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，各比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		国联中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
374	147,983.16	6,100,270.00	11.02%	3,031,330.00	5.48%	46,214,100.00	83.50%

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	中信证券股份有限公司	5,231,400.00	9.45%
2	简街香港有限公司—JSQB有限公司(R)	750,570.00	1.36%
3	王道顺	500,000.00	0.90%
4	黄啸	375,100.00	0.68%
5	林林	288,800.00	0.52%
6	陈建慧	100,000.00	0.18%
7	杭州稻达私募基金管理有限公司—稻达盛禾2号私募证	69,400.00	0.13%

	券投资基金		
8	曹兆熊	67,000.00	0.12%
9	姜才康	50,000.00	0.09%
10	范佑娟	50,000.00	0.09%
-	中国光大银行股份有限公司—国联中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金	46,214,100.00	83.50%

注：1.本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人；
2.前十名持有人为除国联中证500ETF联接基金之外的前十名持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本报告期末，本基金基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金；
2、本基金基金经理未持有本开放式基金。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2019年11月15日)基金份额总额	235,345,700.00
本报告期期初基金份额总额	59,345,700.00
本报告期基金总申购份额	4,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	8,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	55,345,700.00

注：申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于2025年3月25日发布公告，国联基金管理有限公司副总裁刘鲁旦先生离任。

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

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

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

本报告期间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

本报告期内，为本基金进行审计的会计师事务所为上会会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内未变更为其提供审计服务的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内管理人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期无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	
渤海证券	2	10,761,587.00	37.61%	2,690.84	43.49%	-

广发证券	2	17,849,416.03	62.39%	3,496.39	56.51%	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-

注：①根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》等法规及监管要求，公司制定了选择券商的标准，即为：

- 1、财务状况良好；
- 2、经营行为规范；
- 3、合规风控能力和交易能力较强；
- 4、研究能力较强，可为公司提供需要的研究支持。研究能力包括但不限于：
 - (1) 有较强的宏观及行业研究能力。能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并进行路演、培训等。
 - (2) 有较强的数据资源提供能力。拥有丰富的数据库资源，能够及时准确地为公司提供国内外宏观经济、政策、行业、公司等各层面的学术文献、研究报告、信息资讯、数据资源等。
 - (3) 有提供特色定制服务的能力。能够根据不同类型基金投资的特点，提供专门的定制研究和定制服务（如专题研究、专题会议、专题路演、专题研讨等）。

②券商专用交易单元选择程序：

- 1、对提供服务的券商按照上述标准进行遴选及审批，确定合作券商；
- 2、本基金管理人与合作券商签订相关协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
渤海证券	7,800.06	100.00%	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	35,500,000.00	100.00%	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-

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	国联基金管理有限公司关于增加大同证券有限责任公司为国联中证500交易型开放式指数证券投资基金申购赎回代办券商的公告?	中国证监会指定报刊及网站	2025-02-07
2	国联基金管理有限公司关于增加国盛证券有限责任公司为国联中证500交易型开放式指数证券投资基金申购赎回代办券商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025-02-12
3	关于国联基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025-03-19
4	国联基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2025-03-25
5	国联基金管理有限公司关于增加国信证券股份有限公司、联储证券股份有限公司为国联中证500交易型开放式指数证券投资基金申购赎回代办券商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025-04-23
6	国联基金管理有限公司关于国联基金直销电子交易平台等业务临时暂停服务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025-04-25
7	国联基金管理有限公司关于增加中信证券股份有限公司为国联中证500交易型开放式指数证券投资基金申购赎回代办券商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025-05-27

§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
联接基金	1	20250101-20250630	52,416,100.00	264,600.00	6,466,600.00	46,214,100.00	83.50%
产品特有风险							
<p>本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，该类投资者大额赎回所持有的基金份额时，将可能产生流动性风险，即基金资产不能迅速变现，或者未能以合理的价格变现基金资产以支付投资者赎回款，对资产净值产生不利影响。</p> <p>当开放式基金发生巨额赎回，基金管理人认为基金组合资产变现能力有限或认为因应对赎回导致的资产变现对基金单位份额净值产生较大的波动时，为了切实保护存量基金份额持有人的合法权益，可能出现延期支付赎回款等情形。同时为了公平对待所有投资者合法权益不受损害，管理人有权根据基金合同和招募说明书的约定，暂停或者拒绝申购、暂停赎回，基金份额持有人存在可能无法及时赎回持有的全部基金份额的风险。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予中融中证500交易型开放式指数证券投资基金注册的批复文件
- (2) 《国联中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- (3) 《国联中证500交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- (4) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (5) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (6) 中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可在支付工本费后，在合理时间取得上述文件的复印件。

咨询电话：国联基金管理有限公司客户服务电话400-160-6000，(010) 56517299。

网址：<http://www.glfund.com/>

国联基金管理有限公司
二〇二五年八月三十一日