

中融中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

2021 年中期报告

2021 年 06 月 30 日

基金管理人:中融基金管理有限公司

基金托管人:中国光大银行股份有限公司

送出日期:2021 年 08 月 28 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2021年8月26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2021年1月1日起至2021年6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 中期财务会计报告(未经审计)	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
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	59
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	60
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	60
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	60
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
7.12 投资组合报告附注	61
§8 基金份额持有人信息	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
8.2 期末上市基金前十名持有人	62

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	63
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.....	63
§9 开放式基金份额变动.....	63
§10 重大事件揭示.....	63
10.1 基金份额持有人大会决议.....	64
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.....	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	64
10.4 基金投资策略的改变.....	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	64
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.....	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	64
10.8 其他重大事件.....	65
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	66
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.....	66
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	66
§12 备查文件目录.....	66
12.1 备查文件目录.....	66
12.2 存放地点.....	67
12.3 查阅方式.....	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中融中证500交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	中融500
场内简称	中融500（基金扩位简称：中融中证500ETF）
基金主代码	515550
基金运作方式	交易型开放式（ETF）
基金合同生效日	2019年11月15日
基金管理人	中融基金管理有限公司
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	21,345,700.00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	2019-12-25

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	中融基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周妹云
	联系电话	010-56517000
	电子邮箱	zhoumeiyun@zrfunds.com.cn
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3088号中洲大厦3202、3203B	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	北京市朝阳区望京东园四区2号楼17层1701号01室	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码	100102	100033
法定代表人	王瑶	李晓鹏

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	http://www.zrfunds.com.cn/
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
----	----	------

注册登记机构	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
	(2021年01月01日- 2021年06月30日)
本期已实现收益	3,688,150.66
本期利润	2,726,633.03
加权平均基金份额本期利润	0.1127
本期加权平均净值利润率	8.56%
本期基金份额净值增长率	8.48%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末
	(2021年06月30日)
期末可供分配利润	8,508,050.76
期末可供分配基金份额利润	0.3986
期末基金资产净值	29,853,750.76
期末基金份额净值	1.3986
3.1.3 累计期末指标	报告期末
	(2021年06月30日)
基金份额累计净值增长率	39.86%

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

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

3、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	1.61%	0.72%	1.18%	0.73%	0.43%	-0.01%
过去三个月	10.07%	0.66%	8.86%	0.68%	1.21%	-0.02%
过去六个月	8.48%	0.96%	6.93%	0.99%	1.55%	-0.03%
过去一年	18.47%	1.23%	16.09%	1.25%	2.38%	-0.02%
自基金合同 生效起至今	39.86%	1.31%	38.60%	1.40%	1.26%	-0.09%

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

中融中证500交易型开放式指数证券投资基金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-2021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

本基金管理人为中融基金管理有限公司，成立于2013年5月31日，由中融国际信托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2021年6月30日，中融基金管理有限公司共管理67只基金，包括中融货币市场基金、中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金、中融融安灵活配置混合型证券投资基金、中融新机遇灵活配置混合型证券投资基金、中融中证银行指数证券投资基金(LOF)、中融鑫起点灵活配置混合型证券投资基金、中融国证钢铁行业指数型证券投资基金、中融中证煤炭指数型证券投资基金、中融融安二号灵活配置混合型证券投资基金、中融稳健添利债券型证券投资基金、中融新经济灵活配置混合型证券投资基金、中融日日盈交易型货币市场基金、中融产业升级灵活配置混合型证券投资基金、中融融裕双利债券型证券投资基金、中融竞争优势股票型证券投资基金、中融融信双盈债券型证券投资基金、中融现金增利货币市场基金、中融上海清算所银行间1-3年高等级信用债指数发起式证券投资基金、中融上海清算所银行间1-3年中高等级信用债指数发起式证券投资基金、中融恒泰纯债债券型证券投资基金、中融鑫思路灵活配置混合型证券投资基金、中融物联网主题灵活配置混合型证券投资基金、中融量化智选混合型证券投资基金、中融盈泽中短债债券型证券投资基金、中融恒信纯债债券型证券投资基金、中融睿祥纯债债券型证券投资基金、中融核心成长灵活配置混合型证券投资基金、中融沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金、中融聚商3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金、中融季季红定期开放债券型证券投资基金、中融智选红利股票型证券投资基金、中融聚安3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融量化精选混合型基金中基金(FOF)、中融医疗健康精选混合型证券投资基金、中融聚业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融恒裕纯债债券型证券投资基金、中融聚明3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融恒惠纯债债券型证券投资基金、中融央视财经50交易型开放式指数证券投资基金、中融央视财经50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中融策略优选混合型证券投资基金、中融恒鑫纯债债券型证券投资基金、中融聚汇3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融高股息精选混合型证券投资基金、中融睿享86个月定期开放债券型证券投资基金、中融中证500交易型开放式指数证券投资基金、中融聚通3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融睿嘉39个月定期开放债券型证券投资基金、中融中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中融恒安纯债债券型证券投资基金、中融智选对冲策略3个月定期开放混合型证券投资基金、中融品牌优选混合型证券投资基金、中融1-5年国开行债券指数证券投资基金、中融聚锦一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中融融慧双欣一年定期开放债券型证券投资基金、中融价值成长6个月持有期混合型证券投资基金、中融创业板两年定期开放混合型证券投资基金、中融成长优选混合型证券投资基金、中融景瑞一年持有期混合型证券投资基金、中融产业趋势一年定期开放混合型证券投资基金、中融景

颐6个月持有期混合型证券投资基金、中融行业先锋6个月持有期混合型证券投资基金、中融鑫锐研究精选一年持有期混合型证券投资基金、中融景盛一年持有期混合型证券投资基金、中融恒益纯债债券型证券投资基金、中融恒阳纯债债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵菲	中融中证银行指数证券投资基金（LOF）、中融国证钢铁行业指数型证券投资基金、中融中证煤炭指数型证券投资基金、中融央视财经50交易型开放式指数证券投资基金、中融央视财经50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中融中证500交易型开放式指数证券投资基金、中融中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中融智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、中融智选红利股票型证券投资基金的基金经理及数量投资部联席总经理。	2019-11-15	-	12	赵菲先生，中国国籍，毕业于北京师范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12年。2008年8月至2011年5月曾任国泰君安证券股份有限公司证券及衍生品投资总部投资经理；2011年5月至2012年11月曾任嘉实基金管理有限公司结构产品投资部专户投资经理。2012年11月加入中融基金管理有限公司，现任数量投资部联席总经理。
陈薪羽	中融央视财经50交易型开放式指数证券投资基金、中融央视财经50交易型开	2019-11-28	-	5	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、

	放式指数证券投资基金联接基金、中融中证500交易型开放式指数证券投资基金、中融中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中融量化智选混合型证券投资基金、中融智选红利股票型证券投资基金的基金经理。				硕士学位，具有基金从业资格，证券从业年限5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月加入中融基金管理有限公司，现任数量投资部基金经理。
--	--	--	--	--	---

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）证券从业的含义遵从行业协会《证券业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

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

2021年上半年，中证500指数上涨6.93%，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

截至报告期末中融500基金份额净值为1.3986元，本报告期内，基金份额净值增长率为8.48%，同期业绩比较基准收益率为6.93%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年上半年，市场在经历春节后的快速大幅调整后，于二季度逐步恢复，包括沪深300、上证指数在内的大盘指数基本回到年初水平，其中成长风格大幅跑赢，周期板块整体表现较好。

展望下半年，全球范围内，复苏向服务业转移，海外供应链虽仍未完全恢复，但各主要经济体的经济在持续修复中，中国有望率先进入“疫后新常态”。国内GDP增长放缓，消费增速修复缓慢，虽然2季度末社融增速止跌企稳，但偿债负担仍在上升。此外，本轮的供给不平衡超出预期，一方面资源再配置导致劳动市场短期出现供需错配，中低端劳动力市场求人倍率和失业率同时上升；另一方面供应链问题和企业经营思维的变化，导致补产能的不积极和弹性产能的超预期下降，短时间内将继续支撑物价，因此经济面临两大主要矛盾，即成本上升和偿债压力。即使如此，央行应不会因为供给约束导致的成本上升采取收紧货币的政策，反而会关注物价上涨对企业利润的挤压、债务风险的形成，“紧信用、松货币、宽政策”将仍然是未来一段时间央行的主基调。

市场方面，已经采取的降准等措施，将有望维持下半年的流动性宽裕，在一些高景气行业，中国已具备竞争力或正在壮大产业链，形成国产替代，市场焦点将从此前的通货膨胀，转向更加关注企业盈利增长的可持续性。

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

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金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。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所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。报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会，成员由高级管理人员、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。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，基金经理参加估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司以及中国证券业协会等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金存在连续20个工作日基金资产低于5000万的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在中融中证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《中融中证500交易型开放式指数证券投资基金2021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 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：中融中证500交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,510,127.68	2,842,911.43
结算备付金		469,016.40	495,926.98
存出保证金		194,468.98	551,504.19
交易性金融资产	6.4.7.2	27,365,058.38	41,802,779.04
其中：股票投资		27,365,058.38	41,802,779.04
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		376,308.20	426.53
应收利息	6.4.7.5	516.58	848.06
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		29,915,496.22	45,694,396.23
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020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		-	-
应付证券清算款		-	17,342.71
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		7,250.40	11,843.40
应付托管费		2,416.78	3,947.80
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.6	13,217.47	20,645.03
应交税费		1,959.89	4,767.94
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	36,900.92	65,000.00
负债合计		61,745.46	123,546.88
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.8	21,345,700.00	35,345,700.00
未分配利润	6.4.7.9	8,508,050.76	10,225,149.35

所有者权益合计		29,853,750.76	45,570,849.35
负债和所有者权益总计		29,915,496.22	45,694,396.23

注：报告截止日2021年06月30日，基金份额总额21,345,700.00份，份额净值1.3986元。

6.2 利润表

会计主体：中融中证500交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至202 0年06月30日
一、收入		2,878,825.71	18,187,170.91
1. 利息收入		11,280.23	56,601.28
其中：存款利息收入	6.4.7.10	11,280.23	56,601.28
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）		3,790,319.20	15,838,913.51
其中：股票投资收益	6.4.7.11	3,362,238.06	15,117,127.76
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.12.1	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	209,669.90	-
股利收益	6.4.7.15	218,411.24	721,785.75

3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-961,517.63	1,752,582.00
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	38,743.91	539,074.12
减：二、费用		152,192.68	920,373.58
1. 管理人报酬		47,478.28	210,368.97
2. 托管费		15,826.12	70,122.97
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	48,673.54	554,963.10
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		754.81	-
7. 其他费用	6.4.7.19	39,459.93	84,918.54
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,726,633.03	17,266,797.33
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,726,633.03	17,266,797.33

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中融中证500交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06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）	35,345,700.00	10,225,149.35	45,570,849.35
二、本期经营活动产	-	2,726,633.03	2,726,633.03

生的基金净值变动数(本期利润)			
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)	-14,000,000.00	-4,443,731.62	-18,443,731.62
其中: 1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-14,000,000.00	-4,443,731.62	-18,443,731.62
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)	21,345,700.00	8,508,050.76	29,853,750.76
项 目	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06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)	105,345,700.00	5,203,252.18	110,548,952.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	17,266,797.33	17,266,797.33
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)	-30,000,000.00	-8,865,485.46	-38,865,485.46
其中: 1. 基金申购款	224,000,000.00	16,558,504.64	240,558,504.64
2. 基金赎回款	-254,000,000.00	-25,423,990.10	-279,423,990.10
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)	75,345,700.00	13,604,564.05	88,950,264.05

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

曹健

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

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”)发起,于2019年11月15日募集成立。本基金的基金管理人为中融基金管理有限公司,基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

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份中融500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份中融500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份中融500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于2006年2月15日颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

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2021年06月30日的财务状况以及2021年半年度的经营成果和基金净值变动情况。

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、国家税务总局国家税务总局财税[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》、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、对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴个人所得税，个人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。

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费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
----	-----

	2021年06月30日
活期存款	1,510,127.68
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	1,510,127.68

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	25,341,662.41	27,365,058.38	2,023,395.97
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	25,341,662.41	27,365,058.38	2,023,395.97

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

单位：人民币元

项目	本期末 2021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	1,273,320.00	-	-	-
—股指期货	1,273,320.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,273,320.00	-	-	-

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。于2021年06月30日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2109	中证500期货 2109合约	1	1,333,400.00	60,080.00
总额合计				60,080.00
减：可抵销期货暂收款				60,080.00
股指期货投资净额				0.00

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

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	306.53

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	206.55
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	3.50
合计	516.58

6.4.7.6 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
交易所市场应付交易费用	13,217.47
银行间市场应付交易费用	-
合计	13,217.47

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021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	-
预提费用-审计费	9,916.99
预提费用-信息披露费	24,795.19
应付指数使用费	2,188.74
合计	36,900.92

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	35,345,700.00	35,345,700.00
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-14,000,000.00	-14,000,000.00
本期末	21,345,700.00	21,345,700.00

6.4.7.9 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	14,625,987.28	-4,400,837.93	10,225,149.35
本期利润	3,688,150.66	-961,517.63	2,726,633.03
本期基金份额交易产生的变动数	-6,254,446.57	1,810,714.95	-4,443,731.62
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-6,254,446.57	1,810,714.95	-4,443,731.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,059,691.37	-3,551,640.61	8,508,050.76

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021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	3,761.90
其他	87.90
合计	11,280.23

6.4.7.11 股票投资收益**6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	2,558,541.79
股票投资收益——赎回差价收入	803,696.27
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	3,362,238.06

6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出股票成交总额	21,035,777.44
减：卖出股票成本总额	18,477,235.65
买卖股票差价收入	2,558,541.79

6.4.7.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
赎回基金份额对价总额	18,443,731.62
减：现金支付赎回款总额	9,987,104.62
减：赎回股票成本总额	7,652,930.73
赎回差价收入	803,696.27

6.4.7.12 债券投资收益

无。

6.4.7.13 贵金属投资收益

无。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2021年01月01日至2021年06月30日
期货投资	209,669.90

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	218,411.24
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	218,411.24

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	-971,307.50
——股票投资	-971,307.50
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	10,120.00
——权证投资	-
——期货投资	10,120.00
3. 其他	-

减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	330.13
合计	-961,517.63

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	-
ETF基金替代损益	7,451.68
其他	31,292.23
合计	38,743.91

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。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	48,425.44
银行间市场交易费用	-
期货市场交易费用	248.10
合计	48,673.54

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	9,916.99
信息披露费	24,795.19

证券出借违约金	-
指数使用费	4,747.75
合计	39,459.93

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
中融基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中融中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“中融中证500ETF联接”）	基金管理人管理的其他基金
中国光大银行股份有限公司	基金托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	47,478.28	210,368.97
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：

- ①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付；
- ②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.30%/当年天数；
- ③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 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	15,826.12	70,122.97

注：

- ①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付；
- ②基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%/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

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

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 2021年06月30日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中融中证500ETF联接	15,412,800.00	72.21%	28,874,000.00	81.69%

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 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020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	1,510,127.68	7,430.43	6,129,798.31	46,233.75

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

无

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无

6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

无。

6.4.12 期末（2021年06月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
600460	士兰微	2021-06-30	公告重大事项	56.35	2021-07-01	59.49	3,500	68,686.48	197,225.00	-
600811	东方集团	2021-06-30	公告重大事项	3.05	2021-07-14	3.36	13,400	50,135.78	40,870.00	-

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**

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理**6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金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

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时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。

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 2021年0 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	1,510,127.68	-	-	-	1,510,127.68
结算备付金	469,016.40	-	-	-	469,016.40
存出保证金	194,468.98	-	-	-	194,468.98
交易性金融资产	-	-	-	27,365,058.38	27,365,058.38
应收证券清算款	-	-	-	376,308.20	376,308.20
应收利息	-	-	-	516.58	516.58
资产总计	2,173,613.06	-	-	27,741,883.16	29,915,496.22
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	7,250.40	7,250.40
应付托管费	-	-	-	2,416.78	2,416.78
应付交	-	-	-	13,217.47	13,217.47

易费用					
应交税费	-	-	-	1,959.89	1,959.89
其他负债	-	-	-	36,900.92	36,900.92
负债总计	-	-	-	61,745.46	61,745.46
利率敏感度缺口	2,173,613.06	-	-	27,680,137.70	29,853,750.76
上年度末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,842,911.43	-	-	-	2,842,911.43
结算备付金	495,926.98	-	-	-	495,926.98
存出保证金	551,504.19	-	-	-	551,504.19
交易性金融资产	-	-	-	41,802,779.04	41,802,779.04
应收证券清算款	-	-	-	426.53	426.53
应收利息	-	-	-	848.06	848.06
资产总计	3,890,342.60	-	-	41,804,053.63	45,694,396.23
负债					
应付证券清算款	-	-	-	17,342.71	17,342.71
应付管理人报酬	-	-	-	11,843.40	11,843.40
应付托管费	-	-	-	3,947.80	3,947.80
应付交易费用	-	-	-	20,645.03	20,645.03
应交税费	-	-	-	4,767.94	4,767.94
其他负	-	-	-	65,000.00	65,000.00

债					
负债总计	-	-	-	123,546.88	123,546.88
利率敏感度缺口	3,890,342.60	-	-	41,680,506.75	45,570,849.35

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 2021年06月30日		上年度末 2020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	27,365,058.38	91.66	41,802,779.04	91.73

产—股票投资				
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	27,365,058.38	91.66	41,802,779.04	91.73

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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	沪深300指数上升5%	1,187,346.58	2,204,754.84
	沪深300指数下降5%	-1,187,346.58	-2,204,754.84

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 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

(1) 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，其账面价值接近于公允价值。

(2) 以公允价值计量的金融工具

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。

② 各层次金融工具公允价值

于2021年06月30日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币27,126,963.38元，属于第二层次的余额为人民币238,095.00元，无属于第三层次的余额。

③ 公允价值所属层次间的重大变动

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)等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃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。本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具，在第一层次和第二层次之间无重大转换。

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	27,365,058.38	91.47
	其中：股票	27,365,058.38	91.47
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	1,979,144.08	6.62
8	其他各项资产	571,293.76	1.91
9	合计	29,915,496.22	100.00

注：股票投资项包含可退替代款估值增值。

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	263,570.00	0.88
B	采矿业	938,902.80	3.15
C	制造业	17,139,469.91	57.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	671,581.26	2.25
E	建筑业	498,349.00	1.67
F	批发和零售业	906,505.20	3.04
G	交通运输、仓储和邮政业	521,592.27	1.75
H	住宿和餐饮业	141,226.00	0.47
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,187,098.45	7.33
J	金融业	1,595,348.09	5.34
K	房地产业	879,950.80	2.95
L	租赁和商务服务业	355,702.20	1.19
M	科学研究和技术服务业	441,278.00	1.48

N	水利、环境和公共设施管理业	227,492.00	0.76
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	16,676.40	0.06
Q	卫生和社会工作	72,770.00	0.24
R	文化、体育和娱乐业	269,634.00	0.90
S	综合	237,912.00	0.80
	合计	27,365,058.38	91.66

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	003035	南网能源	40,700	404,558.00	1.36
2	003022	联泓新科	10,600	325,420.00	1.09
3	002709	天赐材料	2,450	261,121.00	0.87
4	000799	酒鬼酒	1,000	255,600.00	0.86
5	603486	科沃斯	1,000	228,080.00	0.76
6	600089	特变电工	16,500	212,025.00	0.71
7	000009	中国宝安	11,400	208,278.00	0.70
8	002340	格林美	21,200	198,220.00	0.66
9	600460	士兰微	3,500	197,225.00	0.66
10	002074	国轩高科	4,500	196,020.00	0.66
11	601233	桐昆股份	7,100	171,039.00	0.57
12	300285	国瓷材料	3,500	170,625.00	0.57
13	300207	欣旺达	4,800	156,288.00	0.52

14	002185	华天科技	9,700	149,283.00	0.50
15	600885	宏发股份	2,300	144,210.00	0.48
16	300316	晶盛机电	2,800	141,400.00	0.47
17	601636	旗滨集团	7,100	131,776.00	0.44
18	600733	北汽蓝谷	9,500	128,060.00	0.43
19	300253	卫宁健康	7,500	122,025.00	0.41
20	300146	汤臣倍健	3,700	121,730.00	0.41
21	300037	新宙邦	1,200	120,120.00	0.40
22	002625	光启技术	5,700	118,617.00	0.40
23	002223	鱼跃医疗	3,100	118,203.00	0.40
24	600884	杉杉股份	5,045	117,649.40	0.39
25	002648	卫星石化	2,980	116,786.20	0.39
26	600219	南山铝业	31,800	114,480.00	0.38
27	601127	小康股份	1,700	113,339.00	0.38
28	002353	杰瑞股份	2,500	111,750.00	0.37
29	002138	顺络电子	2,800	108,556.00	0.36
30	000547	航天发展	5,700	107,559.00	0.36
31	002797	第一创业	14,900	106,386.00	0.36
32	600704	物产中大	13,400	105,458.00	0.35
33	000988	华工科技	4,400	103,488.00	0.35
34	002212	天融信	5,200	102,804.00	0.34
35	601099	太平洋	30,200	102,378.00	0.34
36	002444	巨星科技	3,000	102,240.00	0.34
37	603589	口子窖	1,500	101,535.00	0.34
38	600779	水井坊	800	101,080.00	0.34
39	688099	晶晨股份	900	100,980.00	0.34
40	603737	三棵树	573	100,848.00	0.34
41	601168	西部矿业	8,400	100,212.00	0.34
42	002385	大北农	14,700	99,960.00	0.33
43	688002	睿创微纳	1,000	99,830.00	0.33
44	002422	科伦药业	5,000	99,750.00	0.33

45	000807	云铝股份	8,300	98,770.00	0.33
46	300699	光威复材	1,300	98,735.00	0.33
47	600739	辽宁成大	4,700	97,807.00	0.33
48	603893	瑞芯微	700	97,622.00	0.33
49	300308	中际旭创	2,500	96,300.00	0.32
50	002439	启明星辰	3,300	95,733.00	0.32
51	601117	中国化学	10,900	95,484.00	0.32
52	600392	盛和资源	5,400	93,744.00	0.31
53	000636	风华高科	3,100	93,682.00	0.31
54	000830	鲁西化工	5,000	93,650.00	0.31
55	002030	达安基因	4,356	92,521.44	0.31
56	600862	中航高科	3,000	92,340.00	0.31
57	002078	太阳纸业	6,900	92,115.00	0.31
58	600699	均胜电子	3,600	91,872.00	0.31
59	600068	葛洲坝	12,200	91,378.00	0.31
60	600754	锦江酒店	1,600	91,120.00	0.31
61	600315	上海家化	1,500	90,210.00	0.30
62	002180	纳思达	2,800	90,160.00	0.30
63	300088	长信科技	10,900	90,034.00	0.30
64	600486	扬农化工	800	89,416.00	0.30
65	002250	联化科技	3,200	89,280.00	0.30
66	000630	铜陵有色	32,700	88,944.00	0.30
67	600201	生物股份	5,000	87,250.00	0.29
68	002507	涪陵榨菜	2,300	86,618.00	0.29
69	002013	中航机电	8,600	86,602.00	0.29
70	000039	中集集团	4,700	85,446.00	0.29
71	002075	沙钢股份	7,800	85,098.00	0.29
72	002127	南极电商	8,700	84,999.00	0.28
73	002028	思源电气	2,699	83,102.21	0.28
74	300001	特锐德	2,700	81,297.00	0.27
75	600177	雅戈尔	12,300	81,057.00	0.27

76	601997	贵阳银行	11,300	80,908.00	0.27
77	300223	北京君正	800	80,736.00	0.27
78	000513	丽珠集团	1,600	80,032.00	0.27
79	002511	中顺洁柔	2,900	79,895.00	0.27
80	002273	水晶光电	5,400	79,326.00	0.27
81	601005	重庆钢铁	29,700	79,299.00	0.27
82	600563	法拉电子	500	79,180.00	0.27
83	002299	圣农发展	3,300	78,804.00	0.26
84	603605	珀莱雅	400	78,684.00	0.26
85	000021	深科技	4,100	78,474.00	0.26
86	002092	中泰化学	7,600	78,052.00	0.26
87	600549	厦门钨业	3,700	77,071.00	0.26
88	002465	海格通信	8,100	76,626.00	0.26
89	000050	深天马 A	5,400	76,572.00	0.26
90	600988	赤峰黄金	5,100	76,449.00	0.26
91	000739	普洛药业	2,600	76,440.00	0.26
92	600171	上海贝岭	2,500	76,075.00	0.25
93	300168	万达信息	5,200	75,920.00	0.25
94	002080	中材科技	2,900	75,893.00	0.25
95	002603	以岭药业	2,600	75,816.00	0.25
96	300482	万孚生物	1,170	75,687.30	0.25
97	000825	太钢不锈	10,100	75,649.00	0.25
98	000983	山西焦煤	9,080	75,454.80	0.25
99	600867	通化东宝	6,300	75,222.00	0.25
100	600516	方大炭素	10,100	75,144.00	0.25
101	601128	常熟银行	12,100	75,020.00	0.25
102	600066	宇通客车	6,000	74,940.00	0.25
103	300009	安科生物	5,004	74,559.60	0.25
104	600637	东方明珠	9,100	74,529.00	0.25
105	600536	中国软件	1,300	74,009.00	0.25
106	000998	隆平高科	4,600	73,784.00	0.25

107	600316	洪都航空	1,900	73,112.00	0.24
108	300244	迪安诊断	1,900	72,770.00	0.24
109	600879	航天电子	9,600	72,192.00	0.24
110	600418	江淮汽车	5,800	72,094.00	0.24
111	002152	广电运通	5,500	71,665.00	0.24
112	000750	国海证券	16,900	71,656.00	0.24
113	300070	碧水源	9,800	71,638.00	0.24
114	600369	西南证券	14,700	71,589.00	0.24
115	300463	迈克生物	1,700	71,553.00	0.24
116	600380	健康元	5,200	71,396.00	0.24
117	600529	山东药玻	2,100	71,295.00	0.24
118	000932	华菱钢铁	10,800	71,280.00	0.24
119	601689	拓普集团	1,900	71,117.00	0.24
120	000723	美锦能源	9,400	71,064.00	0.24
121	300618	寒锐钴业	900	70,956.00	0.24
122	600487	亨通光电	6,200	70,680.00	0.24
123	300357	我武生物	1,100	70,532.00	0.24
123	000960	锡业股份	4,400	70,532.00	0.24
125	600827	百联股份	3,500	70,525.00	0.24
126	600166	福田汽车	20,400	70,380.00	0.24
126	300296	利亚德	9,000	70,380.00	0.24
128	000975	银泰黄金	7,400	70,374.00	0.24
129	002131	利欧股份	30,000	70,200.00	0.24
130	002373	千方科技	4,200	70,140.00	0.23
131	300271	华宇软件	3,641	70,089.25	0.23
132	002156	通富微电	2,900	69,716.00	0.23
133	600909	华安证券	12,500	69,625.00	0.23
134	601615	明阳智能	4,300	69,617.00	0.23
135	688208	道通科技	800	69,592.00	0.23
136	600038	中直股份	1,300	68,562.00	0.23
137	002572	索菲亚	2,800	67,760.00	0.23

138	300383	光环新网	4,700	67,633.00	0.23
139	600642	申能股份	10,900	66,926.00	0.22
140	601198	东兴证券	6,100	66,673.00	0.22
141	002926	华西证券	6,900	66,447.00	0.22
142	601866	中远海发	17,601	66,003.75	0.22
143	002065	东华软件	8,300	65,819.00	0.22
144	300115	长盈精密	3,140	64,684.00	0.22
145	603290	斯达半导	200	64,000.00	0.21
146	600271	航天信息	4,900	63,847.00	0.21
147	002500	山西证券	9,500	63,745.00	0.21
148	000623	吉林敖东	4,100	63,509.00	0.21
149	600998	九州通	4,100	63,017.00	0.21
150	002690	美亚光电	1,128	62,897.28	0.21
151	603156	养元饮品	2,200	62,876.00	0.21
152	601699	潞安环能	5,300	62,593.00	0.21
153	002294	信立泰	1,900	62,510.00	0.21
154	000012	南玻 A	6,100	62,464.00	0.21
155	600415	小商品城	12,100	62,315.00	0.21
156	600895	张江高科	3,400	62,118.00	0.21
157	600153	建发股份	7,600	61,560.00	0.21
158	603638	艾迪精密	1,420	60,875.40	0.20
159	600256	广汇能源	18,000	59,940.00	0.20
160	600188	兖州煤业	3,900	59,904.00	0.20
161	600707	彩虹股份	6,300	59,283.00	0.20
162	600535	天士力	4,000	59,240.00	0.20
163	600390	五矿资本	9,900	59,202.00	0.20
164	600667	太极实业	6,500	59,150.00	0.20
165	300418	昆仑万维	3,600	58,968.00	0.20
166	300474	景嘉微	600	58,752.00	0.20
167	600008	首创环保	19,510	58,725.10	0.20
168	300024	机器人	5,500	58,685.00	0.20

169	300630	普利制药	1,118	58,583.20	0.20
170	600497	驰宏锌锗	13,500	58,185.00	0.19
171	002670	国盛金控	5,100	58,089.00	0.19
172	600208	新湖中宝	19,100	58,064.00	0.19
173	002372	伟星新材	2,800	57,876.00	0.19
174	600155	华创阳安	5,400	57,780.00	0.19
175	000878	云南铜业	4,500	57,735.00	0.19
176	600060	海信视像	3,400	57,460.00	0.19
177	000027	深圳能源	6,260	57,404.20	0.19
178	600765	中航重机	2,500	56,625.00	0.19
179	002390	信邦制药	5,400	56,592.00	0.19
180	002382	蓝帆医疗	2,700	56,295.00	0.19
181	600372	中航电子	3,400	56,270.00	0.19
182	603858	步长制药	2,500	56,225.00	0.19
183	300251	光线传媒	5,200	56,212.00	0.19
184	002557	洽洽食品	1,300	56,030.00	0.19
185	600498	烽火通信	3,000	55,890.00	0.19
186	002221	东华能源	5,100	55,845.00	0.19
187	600409	三友化工	5,500	55,605.00	0.19
188	000718	苏宁环球	6,700	55,543.00	0.19
189	002019	亿帆医药	3,200	55,200.00	0.18
190	002174	游族网络	3,200	54,944.00	0.18
191	600141	兴发集团	2,900	54,607.00	0.18
192	002966	苏州银行	7,400	54,390.00	0.18
193	600170	上海建工	19,700	54,372.00	0.18
194	002506	协鑫集成	15,600	54,288.00	0.18
195	002146	荣盛发展	9,600	54,144.00	0.18
196	600875	东方电气	4,900	53,753.00	0.18
197	601717	郑煤机	4,600	53,498.00	0.18
198	300058	蓝色光标	8,800	53,240.00	0.18
199	000401	冀东水泥	4,300	53,105.00	0.18

200	000997	新大陆	3,200	53,088.00	0.18
201	603444	吉比特	100	53,000.00	0.18
202	000738	航发控制	2,542	52,949.86	0.18
203	600511	国药股份	1,600	52,896.00	0.18
204	002683	宏大爆破	1,900	52,763.00	0.18
205	600801	华新水泥	3,000	52,710.00	0.18
206	002958	青农商行	12,300	52,644.00	0.18
207	603866	桃李面包	1,680	52,416.00	0.18
208	000686	东北证券	6,200	52,390.00	0.18
209	002408	齐翔腾达	4,200	52,164.00	0.17
210	600160	巨化股份	5,900	52,156.00	0.17
211	600663	陆家嘴	3,900	51,948.00	0.17
212	300315	掌趣科技	12,200	51,850.00	0.17
213	002195	二三四五	25,400	51,562.00	0.17
214	300017	网宿科技	8,700	50,895.00	0.17
215	688321	微芯生物	1,100	50,809.00	0.17
216	000540	中天金融	18,600	50,778.00	0.17
217	002268	卫士通	2,600	50,648.00	0.17
218	600325	华发股份	7,500	50,550.00	0.17
219	688088	虹软科技	900	50,175.00	0.17
220	000060	中金岭南	11,100	50,172.00	0.17
221	600732	爱旭股份	3,600	50,112.00	0.17
222	600258	首旅酒店	2,100	50,106.00	0.17
223	603707	健友股份	1,200	50,100.00	0.17
224	601992	金隅集团	18,500	49,765.00	0.17
225	601016	节能风电	13,300	49,742.00	0.17
226	600027	华电国际	14,400	49,536.00	0.17
227	600567	山鹰国际	14,300	49,335.00	0.17
228	000961	中南建设	8,300	49,136.00	0.16
229	600859	王府井	1,700	49,096.00	0.16
230	603077	和邦生物	23,500	48,880.00	0.16

231	603225	新凤鸣	2,400	48,720.00	0.16
232	002429	兆驰股份	8,000	48,560.00	0.16
233	600282	南钢股份	13,600	48,416.00	0.16
234	000158	常山北明	4,200	48,258.00	0.16
235	600216	浙江医药	3,000	48,030.00	0.16
236	600500	中化国际	6,100	47,946.00	0.16
237	002191	劲嘉股份	4,500	47,880.00	0.16
238	600528	中铁工业	5,900	47,790.00	0.16
239	600839	四川长虹	16,400	47,724.00	0.16
240	002831	裕同科技	1,600	47,504.00	0.16
241	601577	长沙银行	5,300	47,382.00	0.16
242	000671	阳光城	9,100	47,320.00	0.16
243	603927	中科软	1,100	47,245.00	0.16
244	000898	鞍钢股份	10,600	47,170.00	0.16
245	600737	中粮糖业	4,700	47,047.00	0.16
246	603712	七一二	1,300	46,930.00	0.16
247	002056	横店东磁	3,600	46,800.00	0.16
248	002081	金螳螂	5,900	46,728.00	0.16
249	600598	北大荒	3,100	46,376.00	0.16
250	300212	易华录	1,720	46,285.20	0.16
251	000709	河钢股份	18,800	46,248.00	0.15
252	603260	合盛硅业	600	46,146.00	0.15
253	600728	佳都科技	6,200	45,942.00	0.15
254	000581	威孚高科	2,200	45,826.00	0.15
255	002203	海亮股份	4,300	45,752.00	0.15
256	000999	华润三九	1,700	45,475.00	0.15
257	600808	马钢股份	10,600	45,474.00	0.15
258	002124	天邦股份	6,480	45,424.80	0.15
259	300182	捷成股份	9,100	45,409.00	0.15
260	002595	豪迈科技	1,700	45,390.00	0.15
261	600580	卧龙电驱	3,400	45,220.00	0.15

262	000729	燕京啤酒	6,200	44,888.00	0.15
263	002010	传化智联	5,800	44,718.00	0.15
264	300166	东方国信	3,600	44,496.00	0.15
265	603198	迎驾贡酒	1,000	44,300.00	0.15
266	002281	光迅科技	1,800	44,280.00	0.15
267	603883	老百姓	840	44,251.20	0.15
268	000930	中粮科技	4,900	44,149.00	0.15
269	000488	晨鸣纸业	5,400	43,956.00	0.15
270	600820	隧道股份	8,300	43,907.00	0.15
271	002387	维信诺	4,200	43,806.00	0.15
272	000629	攀钢钒钛	19,000	43,510.00	0.15
273	002004	华邦健康	7,000	43,470.00	0.15
274	002048	宁波华翔	2,200	42,900.00	0.14
275	002745	木林森	3,200	42,880.00	0.14
276	002396	星网锐捷	2,000	42,700.00	0.14
277	002242	九阳股份	1,300	42,237.00	0.14
278	300002	神州泰岳	8,700	42,195.00	0.14
279	600970	中材国际	4,600	42,182.00	0.14
280	600755	厦门国贸	5,100	41,871.00	0.14
281	002563	森马服饰	3,500	41,825.00	0.14
282	600022	山东钢铁	24,300	41,796.00	0.14
283	600037	歌华有线	4,300	41,323.00	0.14
284	600803	新奥股份	2,500	41,275.00	0.14
285	600398	海澜之家	5,700	41,268.00	0.14
286	603000	人民网	2,400	41,256.00	0.14
287	000598	兴蓉环境	7,900	41,159.00	0.14
288	600881	亚泰集团	14,400	41,040.00	0.14
289	601106	中国一重	12,100	41,019.00	0.14
290	600811	东方集团	13,400	40,870.00	0.14
291	002002	鸿达兴业	10,100	39,693.00	0.13
292	002925	盈趣科技	1,020	39,688.20	0.13

293	603885	吉祥航空	2,600	39,676.00	0.13
294	601880	辽港股份	23,200	39,672.00	0.13
295	600039	四川路桥	6,300	39,501.00	0.13
296	000883	湖北能源	8,600	39,474.00	0.13
297	000778	新兴铸管	10,600	39,432.00	0.13
298	000690	宝新能源	7,700	39,347.00	0.13
299	600348	华阳股份	5,300	39,326.00	0.13
300	600782	新钢股份	7,000	39,060.00	0.13
301	600597	光明乳业	2,700	38,907.00	0.13
302	601118	海南橡胶	7,600	38,684.00	0.13
303	000887	中鼎股份	3,200	38,656.00	0.13
304	002701	奥瑞金	7,500	38,550.00	0.13
305	600260	ST凯乐	4,340	38,539.20	0.13
306	601456	国联证券	2,500	38,500.00	0.13
307	600126	杭钢股份	7,500	38,475.00	0.13
308	002249	大洋电机	7,300	38,325.00	0.13
309	600908	无锡银行	6,600	38,280.00	0.13
310	002085	万丰奥威	6,800	38,080.00	0.13
311	002183	怡亚通	6,600	37,818.00	0.13
312	601179	中国西电	9,100	37,492.00	0.13
313	600967	内蒙一机	3,700	37,444.00	0.13
314	600026	中远海能	6,074	37,415.84	0.13
315	600410	华胜天成	4,800	37,248.00	0.12
316	600718	东软集团	3,800	37,164.00	0.12
317	000528	柳工	4,500	36,900.00	0.12
318	002705	新宝股份	1,400	36,750.00	0.12
319	600645	中源协和	1,600	36,720.00	0.12
320	600985	淮北矿业	3,000	36,630.00	0.12
321	002867	周大生	1,850	36,574.50	0.12
322	603568	伟明环保	1,600	36,528.00	0.12
323	600572	康恩贝	8,200	36,408.00	0.12

324	002110	三钢闽光	5,400	36,396.00	0.12
325	600446	金证股份	2,500	36,100.00	0.12
326	000402	金融街	5,300	35,775.00	0.12
327	600167	联美控股	4,000	35,720.00	0.12
328	300072	三聚环保	6,200	35,588.00	0.12
329	002266	浙富控股	7,100	35,429.00	0.12
330	002128	露天煤业	3,400	35,394.00	0.12
331	601598	中国外运	7,000	35,350.00	0.12
332	000970	中科三环	3,700	35,335.00	0.12
333	600064	南京高科	3,800	35,302.00	0.12
334	000877	天山股份	2,700	35,181.00	0.12
335	000089	深圳机场	4,500	34,965.00	0.12
336	601200	上海环境	2,900	34,713.00	0.12
337	002368	太极股份	1,720	34,503.20	0.12
338	000990	诚志股份	2,700	34,371.00	0.12
339	600517	国网英大	5,000	34,050.00	0.11
340	300026	红日药业	8,000	34,000.00	0.11
341	600329	中新药业	1,200	33,708.00	0.11
342	603650	彤程新材	700	33,670.00	0.11
343	002985	北摩高科	340	33,150.00	0.11
344	600158	中体产业	2,900	33,089.00	0.11
345	601718	际华集团	11,700	32,994.00	0.11
346	300376	易事特	4,100	32,964.00	0.11
347	000400	许继电气	2,600	32,916.00	0.11
348	600120	浙江东方	7,660	32,784.80	0.11
349	601975	招商南油	15,300	32,742.00	0.11
350	002233	塔牌集团	3,173	32,618.44	0.11
351	600507	方大特钢	4,767	32,320.26	0.11
352	600307	酒钢宏兴	13,900	32,248.00	0.11
353	000519	中兵红箭	3,000	32,160.00	0.11
354	000090	天健集团	5,800	32,074.00	0.11

355	000959	首钢股份	5,700	32,034.00	0.11
356	600376	首开股份	5,700	31,920.00	0.11
357	000685	中山公用	3,900	31,824.00	0.11
358	601333	广深铁路	15,000	31,800.00	0.11
359	002505	鹏都农牧	14,100	31,584.00	0.11
360	601000	唐山港	13,100	31,571.00	0.11
361	600195	中牧股份	2,632	31,478.72	0.11
362	688029	南微医学	100	31,169.00	0.10
363	002440	闰土股份	3,500	30,975.00	0.10
364	600435	北方导航	3,900	30,966.00	0.10
365	001914	招商积余	1,800	30,924.00	0.10
366	000559	万向钱潮	5,800	30,798.00	0.10
367	600804	鹏博士	6,300	30,492.00	0.10
368	002839	张家港行	5,600	30,464.00	0.10
369	600643	爱建集团	4,300	30,014.00	0.10
370	600673	东阳光	6,600	29,634.00	0.10
371	300133	华策影视	5,000	29,600.00	0.10
372	600373	中文传媒	3,000	29,580.00	0.10
373	601860	紫金银行	8,100	29,403.00	0.10
374	601991	大唐发电	11,000	29,040.00	0.10
375	000758	中色股份	6,100	28,975.00	0.10
376	000967	盈峰环境	4,200	28,854.00	0.10
377	601608	中信重工	7,700	28,798.00	0.10
378	002155	湖南黄金	3,700	28,675.00	0.10
379	600582	天地科技	7,300	28,470.00	0.10
380	002038	双鹭药业	2,700	28,431.00	0.10
381	002936	郑州银行	7,710	28,295.70	0.09
382	000563	陕国投 A	8,740	28,142.80	0.09
383	600388	龙净环保	3,300	28,116.00	0.09
384	600266	城建发展	5,920	28,060.80	0.09
385	600056	中国医药	2,300	27,945.00	0.09

386	601958	金钼股份	4,300	27,864.00	0.09
387	600131	国网信通	2,100	27,804.00	0.09
388	600901	江苏租赁	5,300	27,560.00	0.09
389	600928	西安银行	5,900	27,494.00	0.09
390	600062	华润双鹤	2,300	27,393.00	0.09
391	601098	中南传媒	3,100	27,342.00	0.09
392	603228	景旺电子	1,040	27,248.00	0.09
393	300113	顺网科技	2,100	27,174.00	0.09
394	000681	视觉中国	2,100	27,153.00	0.09
395	002416	爱施德	2,700	27,081.00	0.09
396	600259	广晟有色	800	27,048.00	0.09
397	600095	湘财股份	2,300	26,933.00	0.09
398	600959	江苏有线	8,800	26,840.00	0.09
399	300180	华峰超纤	5,400	26,730.00	0.09
400	600649	城投控股	5,600	26,656.00	0.09
401	600094	大名城	7,000	26,390.00	0.09
402	000415	渤海租赁	10,900	26,378.00	0.09
403	600776	东方通信	2,100	26,040.00	0.09
404	002458	益生股份	2,600	25,922.00	0.09
405	600006	东风汽车	3,500	25,550.00	0.09
406	002399	海普瑞	1,600	25,488.00	0.09
407	600764	中国海防	900	25,470.00	0.09
408	300741	华宝股份	500	25,360.00	0.08
409	600556	天下秀	2,400	25,344.00	0.08
410	601611	中国核建	3,500	25,270.00	0.08
411	600546	山煤国际	3,500	25,130.00	0.08
412	600717	天津港	6,404	25,103.68	0.08
413	600729	重庆百货	900	24,705.00	0.08
414	300257	开山股份	1,700	24,429.00	0.08
415	600633	浙数文化	3,400	24,412.00	0.08
416	000717	韶钢松山	5,300	24,327.00	0.08

417	002317	众生药业	2,800	24,108.00	0.08
418	600863	内蒙华电	10,300	23,999.00	0.08
419	000078	海王生物	7,300	23,798.00	0.08
420	600648	外高桥	1,600	23,648.00	0.08
421	601928	凤凰传媒	3,300	23,562.00	0.08
422	002434	万里扬	2,900	23,519.00	0.08
423	600021	上海电力	3,400	23,494.00	0.08
424	000501	鄂武商 A	2,000	23,400.00	0.08
425	600968	海油发展	9,000	23,310.00	0.08
426	002244	滨江集团	5,500	23,045.00	0.08
427	002375	亚厦股份	2,900	22,968.00	0.08
428	002424	贵州百灵	3,100	22,816.00	0.08
429	601828	美凯龙	1,900	22,800.00	0.08
430	600835	上海机电	1,400	22,750.00	0.08
431	000028	国药一致	600	22,704.00	0.08
432	000869	张裕 A	600	22,284.00	0.07
433	600623	华谊集团	2,500	22,025.00	0.07
434	000062	深圳华强	1,300	21,983.00	0.07
435	600377	宁沪高速	2,200	21,472.00	0.07
436	600312	平高电气	3,600	21,024.00	0.07
437	600339	中油工程	7,400	21,016.00	0.07
438	600787	中储股份	3,900	20,787.00	0.07
439	002468	申通快递	2,700	20,574.00	0.07
440	000031	大悦城	5,700	20,520.00	0.07
441	600639	浦东金桥	1,500	20,475.00	0.07
442	000826	启迪环境	3,800	20,330.00	0.07
443	600823	世茂股份	5,000	20,200.00	0.07
444	002583	海能达	4,000	20,160.00	0.07
445	601969	海南矿业	1,700	19,771.00	0.07
446	600466	蓝光发展	6,700	19,765.00	0.07
447	600566	济川药业	1,100	19,690.00	0.07

448	601778	晶科科技	3,600	19,656.00	0.07
449	601298	青岛港	3,100	19,158.00	0.06
450	603317	天味食品	648	19,070.64	0.06
451	603888	新华网	900	19,053.00	0.06
452	600032	浙江新能	1,563	19,006.08	0.06
453	002815	崇达技术	1,500	18,720.00	0.06
454	603355	莱克电气	300	18,669.00	0.06
455	000156	华数传媒	2,400	18,504.00	0.06
456	000937	冀中能源	4,700	18,471.00	0.06
457	002532	天山铝业	2,200	18,458.00	0.06
458	002948	青岛银行	3,600	17,892.00	0.06
459	000813	德展健康	3,900	17,706.00	0.06
460	000553	安道麦A	1,900	17,613.00	0.06
461	002635	安洁科技	1,200	17,556.00	0.06
462	601228	广州港	5,500	17,490.00	0.06
463	002302	西部建设	2,200	17,380.00	0.06
464	603708	家家悦	1,000	17,370.00	0.06
465	600640	号百控股	1,400	17,066.00	0.06
466	300010	豆神教育	3,000	17,010.00	0.06
467	001872	招商港口	1,000	16,920.00	0.06
468	603377	东方时尚	1,560	16,676.40	0.06
469	600350	山东高速	2,700	16,605.00	0.06
470	000061	农产品	3,000	16,560.00	0.06
471	600871	石化油服	8,400	16,548.00	0.06
472	601139	深圳燃气	2,500	16,400.00	0.05
473	000046	泛海控股	6,900	15,870.00	0.05
474	603515	欧普照明	600	15,402.00	0.05
475	002653	海思科	700	15,064.00	0.05
476	601528	瑞丰银行	947	14,744.79	0.05
477	601568	北元集团	1,700	14,552.00	0.05
478	603056	德邦股份	1,300	14,287.00	0.05

479	603379	三美股份	760	14,219.60	0.05
480	002419	天虹股份	2,100	13,776.00	0.05
481	600657	信达地产	3,800	13,224.00	0.04
482	601003	柳钢股份	2,200	12,980.00	0.04
483	601512	中新集团	1,300	12,948.00	0.04
484	000537	广宇发展	2,400	12,552.00	0.04
485	601801	皖新传媒	2,600	12,272.00	0.04
486	601869	长飞光纤	500	12,180.00	0.04
487	605358	立昂微	100	11,558.00	0.04
488	601187	厦门银行	1,200	11,376.00	0.04
489	600917	重庆燃气	1,300	10,621.00	0.04
490	002946	新乳业	700	10,605.00	0.04
491	603983	丸美股份	200	10,422.00	0.03
492	000732	泰禾集团	4,400	9,504.00	0.03
493	600903	贵州燃气	1,000	9,200.00	0.03
494	603719	良品铺子	200	9,000.00	0.03
495	603868	飞科电器	200	8,412.00	0.03
496	603786	科博达	100	7,550.00	0.03
497	002901	大博医疗	100	7,289.00	0.02
498	002423	中粮资本	800	7,240.00	0.02
499	600956	新天绿能	600	7,026.00	0.02
500	002818	富森美	570	6,874.20	0.02
501	001208	华菱线缆	842	6,508.66	0.02
502	603256	宏和科技	700	6,398.00	0.02
503	603171	税友股份	254	4,876.80	0.02
504	601068	中铝国际	1,300	4,485.00	0.02
505	605011	杭州热电	226	2,006.88	0.01

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值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	603719	良品铺子	766,024.00	1.68
2	003035	南网能源	423,206.80	0.93
3	003022	联泓新科	318,901.00	0.70
4	000799	酒鬼酒	243,915.00	0.54
5	603444	吉比特	139,307.00	0.31
6	601636	旗滨集团	131,004.00	0.29
7	300253	卫宁健康	126,084.00	0.28
8	300037	新宙邦	120,406.00	0.26
9	603345	安井食品	117,270.00	0.26
10	688002	睿创微纳	104,134.00	0.23
11	002422	科伦药业	103,993.00	0.23
12	002439	启明星辰	102,738.00	0.23
13	300308	中际旭创	102,151.00	0.22
14	600177	雅戈尔	94,622.00	0.21
15	600068	葛洲坝	88,110.00	0.19
16	600988	赤峰黄金	85,972.00	0.19
17	002127	南极电商	83,454.00	0.18
18	600637	东方明珠	81,139.00	0.18
19	600066	宇通客车	80,689.00	0.18
20	600536	中国软件	80,509.00	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	603719	良品铺子	838,391.41	1.84

2	300274	阳光电源	820,245.95	1.80
3	300012	华测检测	431,127.56	0.95
4	300496	中科创达	316,609.00	0.69
5	300595	欧普康视	303,962.40	0.67
6	002568	百润股份	262,240.00	0.58
7	600426	华鲁恒升	243,476.00	0.53
8	603444	吉比特	228,495.00	0.50
9	002791	坚朗五金	228,407.00	0.50
10	600132	重庆啤酒	203,456.00	0.45
11	603806	福斯特	199,269.20	0.44
12	002920	德赛西威	196,334.00	0.43
13	603882	金域医学	187,643.00	0.41
14	600143	金发科技	180,801.00	0.40
15	002709	天赐材料	172,443.00	0.38
16	601966	玲珑轮胎	170,300.00	0.37
17	002074	国轩高科	166,330.00	0.36
18	300285	国瓷材料	164,965.00	0.36
19	603345	安井食品	143,596.00	0.32
20	002064	华峰化学	143,520.00	0.31

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	12,663,753.22
卖出股票收入（成交）总额	21,035,777.44

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 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

代码	名称	持仓量 (买/ 卖)	合约 市值	公允 价值 变动	风险说明
IC2109	中证500期货2109合约	1	1,333,400.00	60,080.00	本报告期内，本基金投资股指期货根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，进行多头套期保值操作。
公允价值变动总额合计（元）					60,080.00
股指期货投资本期收益（元）					209,669.90
股指期货投资本期公允价值变动（元）					10,120.00

7.10.2 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，利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，实现更紧密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

本基金本报告期末未持有国债期货。

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南网能源(003035)外其他证券的发行主体本期末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。国家税务总局佛山市三水区税务局2020年07月20日发布对南方电网综合能源股份有限公司的处罚。前述发行主体受到的处罚未影响其正常业务运作。对上述证券的投资决策程序的说明:本基金为指数型基金,上述证券系标的指数成份股,因复制指数而被动持有,上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的规定。

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	194,468.98
2	应收证券清算款	376,308.20
3	应收股利	-
4	应收利息	516.58
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	571,293.76

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产	流通受限情况说明
----	------	------	-------------	-------	----------

				产净值比例 (%)	
1	600460	士兰微	197,225.00	0.66	公告重大事项停牌

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，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		中融中证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
299	71,390.30	37,400.00	0.20%	5,895,500.00	27.62%	15,412,800.00	72.18%

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	陈建仁	1,257,670.00	5.89%
2	钱中明	738,300.00	3.46%
3	王道顺	500,000.00	2.34%
4	李园园	333,400.00	1.56%
5	王琦	197,100.00	0.92%
6	朱军	138,000.00	0.65%
7	李素萍	100,000.00	0.47%
8	陈建慧	100,000.00	0.47%
9	胡春芳	100,000.00	0.47%
10	邵经坤	100,000.00	0.47%
-	中国光大银行股份有限公司—中融中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金	15,412,800.00	72.21%

注：前十名持有人为除中融中证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

本报告期末，本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

- 1、本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人未持有本基金；
- 2、本基金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(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	35,345,700.00
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	14,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	21,345,700.00

§ 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

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

本基金管理人于2021年6月19日发布公告，罗杰先生因个人原因提出离职，不再担任中融基金管理有限公司副总裁。

公司其他高管人员未变动。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

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

本报告期无管理人、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	
渤海	2	10,962,262.28	32.83%	8,017.62	32.83%	-

证券						
广发 证券	2	22,432,083.63	67.17%	16,403.48	67.17%	-
申万 宏源	2	-	-	-	-	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

- i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。
- ii 公司财务状况良好。
- iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。
- iv 有较强的研究能力，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，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。
- v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

- i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

- ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

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

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	中融基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票及相关风险提示的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-04
2	中融基金管理有限公司关于公司董事变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-06
3	中融基金管理有限公司关于设立上海分公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-27
4	中融基金管理有限公司关于公司董事变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-17
5	中融基金管理有限公司关于	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-30

	旗下部分公募基金增加侧袋机制并根据《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》修订基金合同部分条款的公告		
6	中融基金管理有限公司关于提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-23
7	中融基金管理有限公司高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-19

§ 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
中融中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	20210101-20210630	28,874,000.00	600,000.00	14,061,200.00	15,412,800.00	72.21%

产品特有风险

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。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。

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) 《中融中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

- (3) 《中融中证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：中融基金管理有限公司客户服务电话400-160-6000，（010）56517299。

网址：<http://www.zrfunds.com.cn/>

中融基金管理有限公司
二〇二一年八月二十八日