

银华中证 A500 交易型开放式指数证券投资 基金 2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：中信建投证券股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中信建投证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 08 月 27 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 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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	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	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	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	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 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	52

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	52
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	52
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 投资组合报告附注	53
§8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末上市基金前十名持有人	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	55
§9 开放式基金份额变动	55
§10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
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	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
10.8 其他重大事件	57
§11 影响投资者决策的其他重要信息	58
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	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	59
§12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	A500ETF
场内简称	A500ETF
基金主代码	159339
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 9 月 26 日
基金管理人	银华基金管理股份有限公司
基金托管人	中信建投证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	6,338,086,841.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易场所	深圳证券交易所
上市日期	2024 年 10 月 15 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用被动指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。在正常市场情况下，本基金力争实现日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。
投资策略	本基金主要采取完全复制法跟踪标的指数，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。 本基金标的指数为中证 A500 指数及其未来可能发生的变更。 本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股(均含存托凭证，下同)。在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等，因法律法规的规定而受限制的情形除外。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期风险和预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金。 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		银华基金管理股份有限公司	中信建投证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨文辉	朱志明
	联系电话	(010) 58163000	4008-888-108
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	service@csc.com.cn

客户服务电话	4006783333, (010)85186558	95587
传真	(010) 58163027	010-56162085
注册地址	广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层	北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼
办公地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场 C2 办公楼 15 层	北京市朝阳区景辉街 16 号院 1 号楼泰康集团大厦 8 层/18 层，北京市朝阳区光华路 10 号院中信大厦 82 层
邮政编码	100738	100010
法定代表人	王珠林	刘成

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.yhfund.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(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-16,356,077.06
本期利润	118,703,743.99
加权平均基金份额本期利润	0.0144
本期加权平均净值利润率	1.51%
本期基金份额净值增长率	1.54%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-142,855,034.44
期末可供分配基金份额利润	-0.0225
期末基金资产净值	6,195,231,806.56
期末基金份额净值	0.9775
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-2.25%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用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。

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

3、本报告中所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，例如：基金的认购、

申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	3.50%	0.59%	2.82%	0.60%	0.68%	-0.01%
过去三个月	1.82%	1.19%	0.84%	1.20%	0.98%	-0.01%
过去六个月	1.54%	1.10%	0.47%	1.10%	1.07%	0.00%
自基金合同生效起至今	-2.25%	1.17%	17.60%	1.58%	-19.85%	-0.41%

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



注：本基金合同生效日期为 2024 年 09 月 26 日，自基金合同生效日起到本报告期末不满一年，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同的规定：本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股(均含存托凭证)。在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

§ 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

银华基金管理股份有限公司成立于 2001 年 5 月，注册资本 2.222 亿人民币，是一家全牌照、综合型资产管理公司。公司注册地为深圳，有北京和上海两家分公司，银华资本、银华国际、银华永泰三家子公司。公司拥有企业年金基金投资管理人、合格境内机构投资者（QDII）、特定客户资产管理人、社保基金境内委托投资管理人、保险资金投资管理人、基本养老保险基金证券投资管理机构、基金投资顾问业务试点等多项业务资格。截至 2025 年上半年，银华基金管理公募基金 227 只，建立了覆盖权益、固收、量化、QDII、FOF、REITs 等类型的全系列产品线。

银华基金秉承“坚持做长期正确的事”的企业价值观，在业内树立了良好的品牌形象，赢得了投资者和业界的广泛认可，十次获得“金牛基金管理公司”奖。公司坚持践行企业社会责任，成立深圳市银华公益基金会，致力于改善贫困人口生活水平，推动社会教育环境的改善，促进教育公平和可持续发展；并自 2020 年起连续五年实现运营层面碳中和。

银华基金始终坚持以客户为中心，持有人利益至上，做价值投资理念的坚定追随者，不盲目追求短期收益，注重控制投资风险，以细水长流的方式积蓄力量，追求长期持续的稳健回报。

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		
马君女士	本基金的基金经理	2024 年 9 月 26 日	-	16.5 年	硕士学位。2008 年 7 月至 2009 年 3 月任职大成基金管理有限公司助理金融工程师。2009 年 3 月加盟银华基金管理有限公司，曾担任研究员及基金经理助理职务。自 2012 年 9 月 4 日至 2020 年 11 月 30 日担任银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金基金经理，2013 年 12 月 16 日至 2015 年 7 月 16 日兼任银华消费主题分级混合型证券投资基金基金经理，2015 年 8 月 6 日至 2016 年 8 月 5 日兼任银华中证国防安全指数分级证券投资基金基金经理，2015 年 8 月 13 日至 2016 年 8 月 5 日兼任银华中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金经理，自 2016 年 1 月 14 日至 2021 年 2 月 25 日兼任银华抗通胀主题证券投资基金（LOF）基金经理，自 2017 年 9 月 15 日至 2020 年 12 月 10 日兼任银

					华智能汽车量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2017 年 11 月 9 日至 2021 年 2 月 25 日兼任银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2017 年 11 月 9 日起兼任银华医疗健康量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2017 年 12 月 15 日至 2024 年 9 月 26 日兼任银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理，2018 年 5 月 11 日至 2021 年 8 月 18 日兼任银华中小市值量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2020 年 1 月 22 日起兼任银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2020 年 3 月 20 日起兼任银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2020 年 5 月 28 日起兼任银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，自 2020 年 9 月 22 日至 2022 年 8 月 9 日兼任银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2020 年 9 月 29 日起兼任银华工银南方东英标普中国新经济行业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理，自 2020 年 12 月 10 日至 2022 年 6 月 29 日兼任银华中证农业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 3 月 3 日起兼任银华中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 4 月 20 日起兼任银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，自 2022 年 6 月 2 日至 2025 年 7 月 11 日兼任银华中证基建交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，自 2022 年 7 月 20 日起兼任银华中证中药交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2023 年 3 月 15 日起兼任银华海外数字经济量化选股混合型发起式证券投资基金（QDII）基金经理，自 2023 年 3 月 17 日起兼任银华中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2023 年 4 月 7 日起兼任银华中证 500 价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2023 年 9 月 6 日起兼任银华
--	--	--	--	--	---

					上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2024 年 1 月 3 日起兼任银华国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2024 年 4 月 25 日起兼任银华中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2024 年 9 月 26 日起兼任银华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2024 年 11 月 13 日起兼任银华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，自 2025 年 4 月 16 日起兼任银华国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。
谭跃峰先生	本基金的基金经理	2024 年 9 月 26 日	-	13.5 年	学士学位。曾就职于交通银行股份有限公司北京分公司。2012 年 8 月加入银华基金，历任量化投资部助理量化研究员、基金经理助理，现任量化投资部基金经理。自 2021 年 12 月 29 日至 2023 年 10 月 24 日担任银华华证 ESG 领先指数证券投资基金、银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 12 月 29 日至 2024 年 4 月 25 日兼任银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，自 2021 年 12 月 29 日至 2024 年 10 月 31 日兼任银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 12 月 29 日起兼任银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 6 月 20 日至 2023 年 10 月 24 日兼任银华中证影视主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 6 月 20 日起兼任银华中证农业主题交易型开放式指数证券投资基金、银华中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 9 月 1 日起兼任银华沪深 300 成长交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 11 月 21 日至 2024 年 11 月 14 日兼任银华中证内地地产主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 11 月 21 日起兼任银华中证机器人交易型开放式指数证券投资基金、银华中证虚拟现实主题交易型开放式指数证券投资

					基金基金经理，自 2022 年 12 月 29 日起兼任银华沪深 300 价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2023 年 7 月 11 日至 2024 年 7 月 30 日兼任银华中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2023 年 12 月 20 日起兼任银华创业板中盘 200 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2024 年 1 月 9 日起兼任银华中证现代物流交易型开放式指数证券投资基金、银华中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2024 年 5 月 6 日起兼任银华中证高股息策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2024 年 9 月 26 日起兼任银华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2024 年 11 月 13 日起兼任银华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，自 2024 年 12 月 24 日起兼任银华沪深 300 价值交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，自 2025 年 1 月 6 日起兼任银华上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2025 年 3 月 11 日起兼任银华上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。
谭普景先生	本基金的基金经理助理	2024 年 9 月 26 日	-	11 年	学士学位。曾就职于上海携宁计算机科技有限公司、上海恒生聚源数据服务有限公司。2013 年 7 月加入银华基金，历任信息技术部开发工程师、开发主管、量化投资部量化研究员，现任量化投资部基金经理助理。具有从业资格。国籍：中国。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。

2、证券从业的含义遵从《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合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《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销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其各项实施准则、《银华中证 A500 交易型开

放式指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,完善相应制度及流程,通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行,公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。本基金管理人对旗下所有投资组合过去两个季度不同时间窗内(1日内、3日内及5日内)同向交易的交易价差从T检验(置信度为95%)和溢价率占优频率等方面进行了专项分析,未发现违反公平交易制度的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内,本基金管理人所有投资组合不存在参与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的5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2025年上半年,国内外宏观经济运行呈现出一些新的特点。国内方面,整体经济格局依然延续弱复苏的态势。在消费品国补等政策支撑下,内需消费稳健。此外,上半年经济中出现了一些新的亮点,如AI、传媒、新消费等新兴行业都出现了热度持久的产品。海外方面,关税战给全球贸易带来了明显的不确定性,全球风险偏好在上半年出现了较大幅度的波动,避险情绪上升。在上述因素的作用下,上半年A股市场呈现波动后修复的特征,上证指数、中证500、创业板指等宽基指数获得正收益。

在报告期内,我们运用自行开发的量化投资管理系统,采用系统管理和人工管理相结合的方式处理基金日常运作中所碰到的申购赎回处理、结构配比较验、风险优化等一系列事件,将本基金的跟踪误差控制在合理水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为0.9775元;本报告期基金份额净值增长率为1.54%,业绩比较基准收益率为0.47%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2025年下半年,我们仍然维持之前的观点。我们认为经济周期的回落与经济的新旧更替

正在同步发生，我们正处于这样的进程中，新的产业链条正在逐渐取代旧产业，成为国民经济的主体支柱。随着这个进程的深入，经济活动的扩张、收入水平的提升，都将是一个缓慢但持续的过程。未来一段时期，国内政策、全球关税冲突、海外地缘冲突等指标将是新的边际影响变量，我们也将对此进行持续的观察。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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同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（委员包括估值业务分管领导以及投资部、研究部、监察稽核部、运作保障部等部门负责人及相关业务骨干），负责研究、指导基金估值业务。估值委员会委员和负责基金日常估值业务的基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。基金经理不介入基金日常估值业务；估值委员会决议之前会与涉及基金的基金经理进行充分沟通。运作保障部负责执行估值委员会制定的估值政策及决议。

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；本基金管理人未签约与估值相关的任何定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在本报告期内，本基金托管人在托管本基金过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

在本报告期内，本基金托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作进行了

监督，未发现基金管理人有关害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中财务指标、净值收益表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告的数据真实、准确和完整（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分，以及涉及关联方和基金份额持有人信息等相关数据未在托管人复核范围内）。

§ 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：银华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	89,708,589.34	217,763,200.90
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	6,125,806,100.79	9,727,051,354.09
其中：股票投资		6,125,806,100.79	9,727,051,354.09
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		801,088.30	14,886,700.26
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		6,216,315,778.43	9,959,701,255.25
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末

		2025 年 6 月 30 日	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		19,805,900.14	76,289,974.26
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		714,057.92	1,208,127.26
应付托管费		238,019.30	402,709.09
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	325,994.51	44,262.30
负债合计		21,083,971.87	77,945,072.91
净 资 产:			
实收基金	6.4.7.10	6,338,086,841.00	10,265,086,841.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-142,855,034.44	-383,330,658.66
净资产合计		6,195,231,806.56	9,881,756,182.34
负债和净资产总计		6,216,315,778.43	9,959,701,255.25

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.9775 元，基金份额总额 6,338,086,841.00 份。

6.2 利润表

会计主体：银华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		126,664,416.21
1. 利息收入		100,605.81
其中：存款利息收入	6.4.7.13	100,605.81
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-19,922,335.04
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-99,809,379.42

基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-
股利收益	6.4.7.19	79,887,044.38
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	135,059,821.05
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	11,426,324.39
减：二、营业总支出		7,960,672.22
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,886,822.40
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,962,274.18
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
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	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.23	111,575.64
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		118,703,743.99
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		118,703,743.99
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		118,703,743.99

注：本基金合同生效日为 2024 年 09 月 26 日，无上年度可比期间数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：银华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	10,265,086,841.00	-	-383,330,658.66	9,881,756,182.34

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	10,265,086,841.00	-	-383,330,658.66	9,881,756,182.34
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3,927,000,000.00	-	240,475,624.22	-3,686,524,375.78
（一）、综合收益总额	-	-	118,703,743.99	118,703,743.99
（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）	-3,927,000,000.00	-	121,771,880.23	-3,805,228,119.77
其中：1. 基金申购款	2,187,000,000.00	-	-128,060,078.94	2,058,939,921.06
2. 基金赎回款	-6,114,000,000.00	-	249,831,959.17	-5,864,168,040.83
（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）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	6,338,086,841.00	-	-142,855,034.44	6,195,231,806.56

注：本基金合同生效日为 2024 年 09 月 26 日，无上年度可比期间数据。

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：

王立新
基金管理人负责人

凌宇翔
主管会计工作负责人

伍军辉
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

银华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2024]1269 号文《关于准予银华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》的注册，由银华基金管理股份有限公司于 2024 年 9 月 10 日至 2024 年 9 月 23 日向社会公开发行募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证出具安永华明（2024）验字第 70026197_A10 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2024 年 9 月 26 日正式生效。本基金为交易型开放式，存续期限不定。设立时募集的 A500ETF 以网下现金认购方式收到首次募集有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 494,506.00 元，折合 494,506.00 份 A500ETF 基金份额；有效认购资金在首次募集期间产生的折份额的利息为人民币 35.00 元，折合 35.00 份 A500ETF 基金份额。A500ETF 以网上现金认购方式收到首次募集有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 1,999,505,457.00 元，折合 1,999,505,457.00 份 A500ETF 基金份额；有效认购资金在首次募集期间产生的折份额的利息为人民币 86,843.00 元，折合 86,843.00 份 A500ETF 基金份额。以上收到的实收基金共计人民币 2,000,086,841.00 元，折合 2,000,086,841.00 份 A500ETF 基金份额。本基金的基金管理人为银华基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中信建投证券股份有限公司。

本基金的投资范围主要投资于标的指数成份股及备选成份股(均含存托凭证，下同)。在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等，因法律法规的规定而受限制的情形除外。同时，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包括主板股票、创业板股票、科创板股票、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、债券资产（包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、公开发行的次级债券、可转换公司债券（含分离交易可转债的纯债部分，下同）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、地方政府债、中期票据、可交换债券以及其他中国证监会允许投资的债券）、银行存款（包括银行定期存款、协议存款及其他银行存款）、资产支持证券、债券回购、同业存单、货币市场工具、现金、衍生工具（股指期货、股票期权）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他

品种或变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围或调整上述投资品种的投资比例，新纳入的投资品种的投资原则及投资比例限制按法律法规或监管机构的相关规定执行。本基金业绩比较基准：中证 A500 指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2025 年 06 月 30 日的财务状况以及 2025 年上半年度的经营成果和净值变动情况。

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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税

实施减半征收。

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、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股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、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；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，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，暂不征收企业所得税。

6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定，自2013年1月1日起，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，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《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》的规定，自2015年9月8日起，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，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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6月30日
活期存款	1,569,878.22
等于：本金	1,569,725.17
加：应计利息	153.05
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	88,138,711.12
等于：本金	88,137,425.14
加：应计利息	1,285.98
减：坏账准备	-
合计	89,708,589.34

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		6,130,118,773.22	-	6,125,806,100.79	-4,312,672.43
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		6,130,118,773.22	-	6,125,806,100.79	-4,312,672.43

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值包含可退替代款估值增值。

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

注：无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

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。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

注：无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	155,837.94
其他	170,156.57

合计	325,994.51
----	------------

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,265,086,841.00	10,265,086,841.00
本期申购	2,187,000,000.00	2,187,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-6,114,000,000.00	-6,114,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	6,338,086,841.00	6,338,086,841.00

6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

6.4.7.12 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	38,459,746.81	-421,790,405.47	-383,330,658.66
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	38,459,746.81	-421,790,405.47	-383,330,658.66
本期利润	-16,356,077.06	135,059,821.05	118,703,743.99
本期基金份额交易产生的变动数	-7,285,893.48	129,057,773.71	121,771,880.23
其中：基金申购款	5,764,211.26	-133,824,290.20	-128,060,078.94
基金赎回款	-13,050,104.74	262,882,063.91	249,831,959.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,817,776.27	-157,672,810.71	-142,855,034.44

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,623.08
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	97,982.73
结算备付金利息收入	-
其他	-

合计	100,605.81
----	------------

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-60,881,128.26
股票投资收益——赎回差价收入	-38,928,251.16
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	-99,809,379.42

6.4.7.14.2 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1月1日至2025年6月30日
卖出股票成交总额	3,962,624,686.15
减：卖出股票成本总额	4,020,314,822.72
减：交易费用	3,190,991.69
买卖股票差价收入	-60,881,128.26

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
赎回基金份额对价总额	5,864,168,040.83
减：现金支付赎回款总额	3,626,797,148.83
减：赎回股票成本总额	2,276,299,143.16
减：交易费用	-
赎回差价收入	-38,928,251.16

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

股票投资产生的股利收益	79,887,044.38
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	79,887,044.38

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	135,059,821.05
股票投资	135,059,821.05
债券投资	—
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	—
权证投资	—
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	135,059,821.05

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	—
替代损益	11,426,324.39
合计	11,426,324.39

6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	42,151.28
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
其他	9,916.99
合计	111,575.64

6.4.7.24 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

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
西南证券股份有限公司（“西南证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
银华基金管理股份有限公司（“银华基金”）	基金管理人
中信建投证券股份有限公司（“中信建投”）	基金托管人、基金代销机构
银华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（“银华中证 A500ETF 发起式联接”）	基金管理人管理的其他基金

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

注：无。

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.4 权证交易

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 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	5,886,822.40
其中：应支付销售机构的客户维护费	645,647.93
应支付基金管理人的净管理费	5,241,174.47

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,962,274.18

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.05\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025 年 6 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（%）
第一创业	-	-	40,909,100.00	0.40
西南证券	103,501,429.00	1.63	20,999,886.00	0.20
银华中证 A500ETF发起 式联接	1,888,784,682.00	29.80	2,704,003,282.00	26.34
中信建投	403,578.00	0.01	89,531,474.00	0.87

注：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。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中信建投	1,569,878.22	2,623.08

注：本基金的银行存款由基金托管人中信建投证券股份有限公司保管，存放在具有基金托管资格的招商银行股份有限公司，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期末投资于基金托管人（中信建投证券股份有限公司）关联方发行的股票：中信证券（600030）2,596,800.00 股，期末公允价值为人民币 71,723,616.00 元，占本基金期末基金资产净值比例为 1.16%。

6.4.11 利润分配情况

注：无。

6.4.12 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新股流通受限	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	6 个月	新股流通受限	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
001390	古麒绒材	2025 年 5 月 21 日	6 个月	新股流通受限	12.08	18.12	178	2,150.24	3,225.36	-
301560	众捷汽车	2025 年 4 月 17 日	6 个月	新股流通受限	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-
301590	优优绿能	2025 年 5 月 28 日	6 个月	新股流通受限	89.60	139.48	73	6,540.80	10,182.04	-
301595	太力科技	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
301636	泽润新能	2025 年 4 月 30 日	6 个月	新股流通受限	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301658	首航新能	2025 年 3 月 26 日	6 个月	新股流通受限	11.80	22.98	437	5,156.60	10,042.26	-
301678	新	2025	6 个月	新股	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	-

	恒 汇	年6月 13日		流通 受限						
603014	威 高 血 净	2025 年5月 12日	6个月	新股 流通 受限	26.50	32.68	205	5,432.50	6,699.40	-

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

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

注：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财务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。本基金管理人建立了以董事会风险控制委员会为核心的，由董事会风险控制委员会、经营管理层及各具体业务部门组成的三道风险监控防线。在董事会领导下，董事会风险控制委员会定期听取审阅公司风险管理报告及相关情况，掌握公司的总体风险状况，确保风险控制与业务发展同步进行；公司总经理负责，由公司投资决策委员会和公司总经理及副总经理组成的经营管理层，通过风险管理部，对各项业务风险状况进行监督并及时制定相应对策和实施控制措施；由各部门总监负责，部门全员参与，根据公司经营计划、业务规则及自身具体情况制定本部门的作业流程及风险控制措施，同时分别在自己的授权范围内对关联部门及岗位进行监督并承担相应职责。

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同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此

违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可按合同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流动性受限资产比例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，使得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。

本基金主要投资品种符合合同规定，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），在正常市场条件下其余均能及时变现。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约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。

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

利率风险是指基金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对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	89,708,589.34	-	-	-	89,708,589.34
交易性金融资产	-	-	-	6,125,806,100.79	6,125,806,100.79
应收清算款	-	-	-	801,088.30	801,088.30
资产总计	89,708,589.34	-	-	6,126,607,189.09	6,216,315,778.43
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	714,057.92	714,057.92
应付托管费	-	-	-	238,019.30	238,019.30
应付清算款	-	-	-	19,805,900.14	19,805,900.14
其他负债	-	-	-	325,994.51	325,994.51
负债总计	-	-	-	21,083,971.87	21,083,971.87
利率敏感度缺口	89,708,589.34	-	-	6,105,523,217.22	6,195,231,806.56
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	217,763,200.90	-	-	-	217,763,200.90
交易性金融资产	-	-	-	9,727,051,354.09	9,727,051,354.09
应收清算款	-	-	-	14,886,700.26	14,886,700.26
资产总计	217,763,200.90	-	-	9,741,938,054.35	9,959,701,255.25
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	1,208,127.26	1,208,127.26
应付托管费	-	-	-	402,709.09	402,709.09
应付清算款	-	-	-	76,289,974.26	76,289,974.26
其他负债	-	-	-	44,262.30	44,262.30
负债总计	-	-	-	77,945,072.91	77,945,072.91
利率敏感度缺口	217,763,200.90	-	-	9,663,992,981.44	9,881,756,182.34

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：本基金持有的利率敏感性资产占基金净资产的比例不重大，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注:无。

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包含单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，以及市场价格变化或波动所引起的股票、债券和基金等各类资产损失的可能性。

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。并且，基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

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 6 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	6,125,806,100.79	98.88	9,727,051,354.09	98.43
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	6,125,806,100.79	98.88	9,727,051,354.09	98.43

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相对应变化带来估测组合市场价格风险；
	Beta 系数是根据过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。

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 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	180,957,415.12	198,800,141.89
	业绩比较基准下降 5%	-180,957,415.12	-198,800,141.89

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	6,125,726,557.93	9,713,557,174.09
第二层次	15,385.54	13,494,180.00
第三层次	64,157.32	—
合计	6,125,806,100.79	9,727,051,354.09

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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。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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均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	6,125,806,100.79	98.54
	其中：股票	6,125,806,100.79	98.54
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	89,708,589.34	1.44
8	其他各项资产	801,088.30	0.01
9	合计	6,216,315,778.43	100.00

注：股票投资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	32,996,108.00	0.53
B	采矿业	308,656,593.50	4.98
C	制造业	3,557,872,758.74	57.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	188,801,900.00	3.05

E	建筑业	116,522,224.00	1.88
F	批发和零售业	43,264,718.20	0.70
G	交通运输、仓储和邮政业	213,765,356.00	3.45
H	住宿和餐饮业	5,277,174.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	407,716,201.66	6.58
J	金融业	991,187,774.04	16.00
K	房地产业	63,981,939.50	1.03
L	租赁和商务服务业	67,886,815.05	1.10
M	科学研究和技术服务业	67,732,807.00	1.09
N	水利、环境和公共设施管理业	13,371,308.00	0.22
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	4,012,578.00	0.06
Q	卫生和社会工作	23,257,184.24	0.38
R	文化、体育和娱乐业	19,422,838.00	0.31
S	综合	-	-
	合计	6,125,726,277.93	98.88

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

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	79,542.86	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共	-	-

	设施管理业		
0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	79,542.86	0.00

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通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	170,310	240,055,351.20	3.87
2	300750	宁德时代	698,920	176,281,602.40	2.85
3	601318	中国平安	2,874,200	159,460,616.00	2.57
4	600036	招商银行	3,303,900	151,814,205.00	2.45
5	601166	兴业银行	4,430,600	103,410,204.00	1.67
6	600900	长江电力	3,269,400	98,539,716.00	1.59
7	000333	美的集团	1,308,097	94,444,603.40	1.52
8	601899	紫金矿业	4,393,600	85,675,200.00	1.38
9	002594	比亚迪	238,800	79,260,108.00	1.28
10	300059	东方财富	3,356,200	77,628,906.00	1.25
11	600030	中信证券	2,596,800	71,723,616.00	1.16
12	601398	工商银行	9,356,000	71,012,040.00	1.15
13	600276	恒瑞医药	1,195,800	62,062,020.00	1.00
14	000858	五粮液	509,000	60,520,100.00	0.98
15	601328	交通银行	7,159,600	57,276,800.00	0.92
16	000651	格力电器	1,199,000	53,859,080.00	0.87
17	601288	农业银行	8,520,800	50,102,304.00	0.81
18	688981	中芯国际	537,096	47,355,754.32	0.76
19	600887	伊利股份	1,685,400	46,988,952.00	0.76
20	600919	江苏银行	3,922,100	46,829,874.00	0.76
21	002475	立讯精密	1,346,000	46,692,740.00	0.75
22	603259	药明康德	664,400	46,209,020.00	0.75
23	601816	京沪高铁	7,823,500	44,985,125.00	0.73
24	600000	浦发银行	3,133,000	43,486,040.00	0.70
25	000725	京东方A	9,754,300	38,919,657.00	0.63
26	002371	北方华创	85,900	37,985,839.00	0.61

27	300760	迈瑞医疗	164,912	37,063,972.00	0.60
28	601088	中国神华	876,600	35,537,364.00	0.57
29	688041	海光信息	247,551	34,976,480.79	0.56
30	300308	中际旭创	235,140	34,297,520.40	0.55
31	601601	中国太保	908,105	34,063,018.55	0.55
32	688256	寒武纪	55,916	33,633,474.00	0.54
33	300502	新易盛	261,240	33,182,704.80	0.54
34	601728	中国电信	4,145,500	32,127,625.00	0.52
35	300124	汇川技术	495,900	32,020,263.00	0.52
36	601668	中国建筑	5,507,500	31,778,275.00	0.51
37	002352	顺丰控股	641,500	31,279,540.00	0.50
38	000001	平安银行	2,583,607	31,184,136.49	0.50
39	002714	牧原股份	721,800	30,322,818.00	0.49
40	002230	科大讯飞	617,149	29,549,094.12	0.48
41	601127	赛力斯	217,200	29,174,304.00	0.47
42	603501	豪威集团	226,100	28,861,665.00	0.47
43	600031	三一重工	1,587,200	28,490,240.00	0.46
44	000063	中兴通讯	856,500	27,827,685.00	0.45
45	603019	中科曙光	392,400	27,624,960.00	0.45
46	002415	海康威视	986,300	27,350,099.00	0.44
47	600309	万华化学	497,000	26,967,220.00	0.44
48	600941	中国移动	238,900	26,888,195.00	0.43
49	300274	阳光电源	389,500	26,396,415.00	0.43
50	601857	中国石油	3,015,800	25,785,090.00	0.42
51	688008	澜起科技	312,899	25,657,718.00	0.41
52	601919	中远海控	1,681,300	25,286,752.00	0.41
53	600690	海尔智家	1,004,500	24,891,510.00	0.40
54	601012	隆基绿能	1,622,181	24,365,158.62	0.39
55	600660	福耀玻璃	426,700	24,326,167.00	0.39
56	600406	国电南瑞	1,070,440	23,988,560.40	0.39
57	601766	中国中车	3,248,100	22,866,624.00	0.37
58	603986	兆易创新	179,300	22,686,829.00	0.37
59	000568	泸州老窖	196,700	22,305,780.00	0.36
60	600050	中国联通	4,168,500	22,259,790.00	0.36
61	000338	潍柴动力	1,447,000	22,254,860.00	0.36
62	300476	胜宏科技	163,800	22,011,444.00	0.36
63	600028	中国石化	3,891,300	21,946,932.00	0.35
64	000100	TCL 科技	4,996,200	21,633,546.00	0.35
65	601988	中国银行	3,837,350	21,565,907.00	0.35
66	688012	中微公司	117,206	21,366,653.80	0.34
67	601006	大秦铁路	3,217,300	21,234,180.00	0.34
68	601985	中国核电	2,199,600	20,500,272.00	0.33
69	601225	陕西煤业	1,035,000	19,913,400.00	0.32

70	600104	上汽集团	1,237,500	19,861,875.00	0.32
71	002027	分众传媒	2,696,800	19,686,640.00	0.32
72	600150	中国船舶	599,079	19,494,030.66	0.31
73	600418	江淮汽车	462,500	18,541,625.00	0.30
74	601628	中国人寿	443,000	18,247,170.00	0.29
75	605499	东鹏饮料	55,800	17,523,990.00	0.28
76	688111	金山办公	62,069	17,382,423.45	0.28
77	603288	海天味业	442,639	17,223,083.49	0.28
78	000425	徐工机械	2,194,000	17,047,380.00	0.28
79	688271	联影医疗	132,450	16,919,163.00	0.27
80	600760	中航沈飞	288,600	16,917,732.00	0.27
81	000792	盐湖股份	988,700	16,886,996.00	0.27
82	000625	长安汽车	1,311,800	16,738,568.00	0.27
83	600111	北方稀土	671,500	16,720,350.00	0.27
84	600938	中国海油	637,700	16,650,347.00	0.27
85	600905	三峡能源	3,812,400	16,240,824.00	0.26
86	601658	邮储银行	2,961,500	16,199,405.00	0.26
87	600436	片仔癀	80,700	16,140,807.00	0.26
88	002625	光启技术	402,100	16,075,958.00	0.26
89	600089	特变电工	1,340,700	15,994,551.00	0.26
90	002050	三花智控	599,100	15,804,258.00	0.26
91	603993	洛阳钼业	1,876,700	15,801,814.00	0.26
92	300033	同花顺	57,700	15,752,677.00	0.25
93	601888	中国中免	257,125	15,676,911.25	0.25
94	300015	爱尔眼科	1,242,400	15,505,152.00	0.25
95	600048	保利发展	1,913,400	15,498,540.00	0.25
96	002463	沪电股份	363,500	15,477,830.00	0.25
97	600019	宝钢股份	2,336,000	15,394,240.00	0.25
98	601390	中国中铁	2,732,900	15,331,569.00	0.25
99	600547	山东黄金	478,300	15,272,119.00	0.25
100	600415	小商品城	738,100	15,263,908.00	0.25
101	300014	亿纬锂能	332,100	15,213,501.00	0.25
102	002241	歌尔股份	649,100	15,137,012.00	0.24
103	601600	中国铝业	2,110,701	14,859,335.04	0.24
104	601989	中国重工	3,045,800	14,132,512.00	0.23
105	002179	中航光电	344,160	13,890,297.60	0.22
106	600893	航发动力	360,100	13,878,254.00	0.22
107	002384	东山精密	367,100	13,865,367.00	0.22
108	000977	浪潮信息	270,200	13,747,776.00	0.22
109	600585	海螺水泥	639,100	13,721,477.00	0.22
110	603799	华友钴业	367,300	13,597,446.00	0.22
111	600570	恒生电子	402,100	13,486,434.00	0.22
112	000538	云南白药	235,800	13,155,282.00	0.21

113	600584	长电科技	385,100	12,974,019.00	0.21
114	000938	紫光股份	539,800	12,949,802.00	0.21
115	601727	上海电气	1,686,400	12,462,496.00	0.20
116	000988	华工科技	264,500	12,434,145.00	0.20
117	002028	思源电气	169,200	12,336,372.00	0.20
118	300408	三环集团	361,800	12,084,120.00	0.20
119	002049	紫光国微	182,400	12,012,864.00	0.19
120	600438	通威股份	715,000	11,976,250.00	0.19
121	300433	蓝思科技	535,849	11,949,432.70	0.19
122	000002	万 科 A	1,811,500	11,629,830.00	0.19
123	600795	国电电力	2,377,700	11,508,068.00	0.19
124	600489	中金黄金	779,200	11,399,696.00	0.18
125	601669	中国电建	2,295,400	11,178,598.00	0.18
126	600988	赤峰黄金	442,400	11,006,912.00	0.18
127	601689	拓普集团	230,600	10,895,850.00	0.18
128	600010	包钢股份	6,051,200	10,831,648.00	0.17
129	300339	润和软件	212,600	10,806,458.00	0.17
130	600009	上海机场	337,900	10,735,083.00	0.17
131	002422	科伦药业	291,800	10,481,456.00	0.17
132	002456	欧菲光	881,000	10,439,850.00	0.17
133	600160	巨化股份	363,100	10,413,708.00	0.17
134	601100	恒立液压	142,700	10,274,400.00	0.17
135	000768	中航西飞	374,424	10,236,752.16	0.17
136	600183	生益科技	331,200	9,985,680.00	0.16
137	002460	赣锋锂业	294,740	9,953,369.80	0.16
138	300394	天孚通信	124,420	9,933,692.80	0.16
139	601186	中国铁建	1,231,700	9,865,917.00	0.16
140	688036	传音控股	122,500	9,763,250.00	0.16
141	002252	上海莱士	1,414,800	9,719,676.00	0.16
142	600839	四川长虹	990,000	9,622,800.00	0.16
143	000157	中联重科	1,321,890	9,557,264.70	0.15
144	600989	宝丰能源	590,000	9,522,600.00	0.15
145	601360	三六零	928,700	9,472,740.00	0.15
146	600886	国投电力	640,700	9,443,918.00	0.15
147	000963	华东医药	232,100	9,367,556.00	0.15
148	600115	中国东航	2,286,300	9,213,789.00	0.15
149	300442	润泽科技	185,900	9,207,627.00	0.15
150	002074	国轩高科	282,100	9,156,966.00	0.15
151	601058	赛轮轮胎	694,600	9,113,152.00	0.15
152	000408	藏格矿业	210,000	8,960,700.00	0.14
153	000807	云铝股份	560,300	8,953,594.00	0.14
154	600066	宇通客车	359,700	8,942,142.00	0.14
155	002517	恺英网络	451,900	8,726,189.00	0.14

156	002340	格林美	1,370,300	8,701,405.00	0.14
157	002001	新 和 成	408,988	8,699,174.76	0.14
158	688169	石头科技	55,534	8,693,847.70	0.14
159	002466	天齐锂业	271,000	8,682,840.00	0.14
160	000661	长春高新	87,300	8,658,414.00	0.14
161	600196	复星医药	343,900	8,628,451.00	0.14
162	600426	华鲁恒升	397,800	8,620,326.00	0.14
163	002558	巨人网络	362,500	8,536,875.00	0.14
164	301236	软通动力	156,200	8,534,768.00	0.14
165	600029	南方航空	1,443,400	8,516,060.00	0.14
166	601800	中国交建	953,400	8,475,726.00	0.14
167	001979	招商蛇口	966,000	8,471,820.00	0.14
168	002236	大华股份	533,100	8,465,628.00	0.14
169	002156	通富微电	330,200	8,459,724.00	0.14
170	002195	岩山科技	1,502,600	8,459,638.00	0.14
171	300661	圣邦股份	116,040	8,444,230.80	0.14
172	600011	华能国际	1,178,000	8,410,920.00	0.14
173	600674	川投能源	522,500	8,380,900.00	0.14
174	000975	山金国际	441,700	8,365,798.00	0.14
175	688126	沪硅产业	437,369	8,187,547.68	0.13
176	600487	亨通光电	534,000	8,170,200.00	0.13
177	600346	恒力石化	567,700	8,095,402.00	0.13
178	300251	光线传媒	395,600	8,018,812.00	0.13
179	601111	中国国航	1,003,000	7,913,670.00	0.13
180	300207	欣旺达	393,300	7,889,598.00	0.13
181	300418	昆仑万维	232,900	7,832,427.00	0.13
182	688608	恒玄科技	22,502	7,830,245.96	0.13
183	600372	中航机载	643,500	7,760,610.00	0.13
184	002648	卫星化学	447,196	7,749,906.68	0.13
185	601868	中国能建	3,468,100	7,733,863.00	0.12
186	688213	思特威	75,587	7,726,503.14	0.12
187	600745	闻泰科技	230,300	7,721,959.00	0.12
188	002916	深南电路	71,247	7,681,139.07	0.12
189	688777	中控技术	169,283	7,602,499.53	0.12
190	600096	云天化	346,000	7,601,620.00	0.12
191	003816	中国广核	2,083,000	7,582,120.00	0.12
192	002920	德赛西威	74,200	7,578,046.00	0.12
193	600460	士兰微	304,200	7,550,244.00	0.12
194	000066	中国长城	509,100	7,534,680.00	0.12
195	601117	中国化学	979,600	7,513,532.00	0.12
196	688120	华海清科	44,220	7,459,914.00	0.12
197	002465	海格通信	534,900	7,456,506.00	0.12
198	002273	水晶光电	373,000	7,448,810.00	0.12

199	600741	华域汽车	420,800	7,427,120.00	0.12
200	601319	中国人保	850,900	7,411,339.00	0.12
201	601168	西部矿业	443,700	7,378,731.00	0.12
202	600588	用友网络	550,400	7,358,848.00	0.12
203	300347	泰格医药	137,100	7,310,172.00	0.12
204	600879	航天电子	698,200	7,310,154.00	0.12
205	600256	广汇能源	1,213,500	7,305,270.00	0.12
206	600176	中国巨石	640,800	7,305,120.00	0.12
207	601021	春秋航空	130,500	7,262,325.00	0.12
208	601633	长城汽车	337,700	7,253,796.00	0.12
209	688235	百济神州	30,785	7,192,607.40	0.12
210	000831	中国稀土	199,100	7,191,492.00	0.12
211	300782	卓胜微	100,700	7,186,959.00	0.12
212	002601	龙佰集团	441,400	7,155,094.00	0.12
213	002555	三七互娱	413,500	7,149,415.00	0.12
214	300450	先导智能	287,100	7,134,435.00	0.12
215	600219	南山铝业	1,860,000	7,123,800.00	0.11
216	300896	爱美客	40,412	7,064,421.72	0.11
217	000786	北新建材	264,900	7,014,552.00	0.11
218	002294	信立泰	148,100	7,009,573.00	0.11
219	600352	浙江龙盛	688,500	6,995,160.00	0.11
220	300017	网宿科技	650,800	6,976,576.00	0.11
221	000933	神火股份	418,100	6,957,184.00	0.11
222	302132	中航成飞	78,800	6,929,672.00	0.11
223	600039	四川路桥	692,700	6,857,730.00	0.11
224	000630	铜陵有色	2,048,700	6,842,658.00	0.11
225	002185	华天科技	676,100	6,828,610.00	0.11
226	688002	睿创微纳	97,822	6,820,149.84	0.11
227	600482	中国动力	295,500	6,817,185.00	0.11
228	600885	宏发股份	303,172	6,763,767.32	0.11
229	688617	惠泰医疗	22,683	6,736,851.00	0.11
230	002493	荣盛石化	809,800	6,705,144.00	0.11
231	688396	华润微	142,015	6,697,427.40	0.11
232	600085	同仁堂	184,400	6,649,464.00	0.11
233	001965	招商公路	552,301	6,627,612.00	0.11
234	002129	TCL 中环	860,000	6,604,800.00	0.11
235	002709	天赐材料	359,300	6,510,516.00	0.11
236	300866	安克创新	57,100	6,486,560.00	0.10
237	688099	晶晨股份	90,674	6,438,760.74	0.10
238	688506	百利天恒	21,565	6,385,827.80	0.10
239	300454	深信服	67,600	6,366,568.00	0.10
240	600362	江西铜业	271,600	6,363,588.00	0.10
241	002281	光迅科技	128,900	6,357,348.00	0.10

242	002131	利欧股份	1, 815, 300	6, 353, 550. 00	0. 10
243	300122	智飞生物	324, 300	6, 353, 037. 00	0. 10
244	601877	正泰电器	280, 200	6, 352, 134. 00	0. 10
245	002130	沃尔核材	265, 800	6, 331, 356. 00	0. 10
246	002595	豪迈科技	106, 800	6, 324, 696. 00	0. 10
247	002085	万丰奥威	397, 200	6, 311, 508. 00	0. 10
248	688122	西部超导	121, 430	6, 299, 788. 40	0. 10
249	000423	东阿阿胶	120, 100	6, 281, 230. 00	0. 10
250	300002	神州泰岳	531, 400	6, 270, 520. 00	0. 10
251	002738	中矿资源	193, 900	6, 235, 824. 00	0. 10
252	300223	北京君正	90, 100	6, 234, 920. 00	0. 10
253	002532	天山铝业	749, 200	6, 225, 852. 00	0. 10
254	600161	天坛生物	324, 100	6, 219, 479. 00	0. 10
255	603129	春风动力	28, 700	6, 213, 550. 00	0. 10
256	603392	万泰生物	101, 500	6, 191, 500. 00	0. 10
257	300058	蓝色光标	935, 780	6, 138, 716. 80	0. 10
258	300474	景嘉微	83, 600	6, 102, 800. 00	0. 10
259	002472	双环传动	181, 900	6, 091, 831. 00	0. 10
260	603596	伯特利	114, 200	6, 017, 198. 00	0. 10
261	300832	新产业	105, 800	6, 000, 976. 00	0. 10
262	002138	顺络电子	213, 200	5, 995, 184. 00	0. 10
263	002078	太阳纸业	443, 500	5, 969, 510. 00	0. 10
264	002180	纳思达	259, 900	5, 962, 106. 00	0. 10
265	002938	鹏鼎控股	185, 800	5, 951, 174. 00	0. 10
266	002436	兴森科技	448, 300	5, 935, 492. 00	0. 10
267	600233	圆通速递	458, 800	5, 913, 932. 00	0. 10
268	300346	南大光电	186, 060	5, 886, 938. 40	0. 10
269	002410	广联达	436, 780	5, 857, 219. 80	0. 09
270	000034	神州数码	155, 600	5, 856, 784. 00	0. 09
271	000301	东方盛虹	699, 700	5, 828, 501. 00	0. 09
272	600143	金发科技	565, 300	5, 828, 243. 00	0. 09
273	300024	机器人	338, 900	5, 822, 302. 00	0. 09
274	600862	中航高科	223, 000	5, 815, 840. 00	0. 09
275	002353	杰瑞股份	166, 100	5, 813, 500. 00	0. 09
276	002223	鱼跃医疗	162, 900	5, 799, 240. 00	0. 09
277	002128	电投能源	292, 300	5, 781, 694. 00	0. 09
278	300054	鼎龙股份	201, 200	5, 770, 416. 00	0. 09
279	688072	拓荆科技	37, 487	5, 762, 126. 77	0. 09
280	688047	龙芯中科	43, 060	5, 743, 773. 40	0. 09
281	002065	东华软件	598, 000	5, 740, 800. 00	0. 09
282	300759	康龙化成	233, 700	5, 734, 998. 00	0. 09
283	600188	兖矿能源	471, 200	5, 734, 504. 00	0. 09
284	002202	金风科技	557, 600	5, 715, 400. 00	0. 09

285	603606	东方电缆	110,200	5,698,442.00	0.09
286	300395	菲利华	111,500	5,697,650.00	0.09
287	601618	中国中冶	1,911,100	5,695,078.00	0.09
288	300136	信维通信	254,000	5,689,600.00	0.09
289	300496	中科创达	98,500	5,636,170.00	0.09
290	688578	艾力斯	60,364	5,616,266.56	0.09
291	000999	华润三九	179,300	5,608,504.00	0.09
292	300383	光环新网	387,500	5,541,250.00	0.09
293	002624	完美世界	364,400	5,527,948.00	0.09
294	688223	晶科能源	1,063,358	5,518,828.02	0.09
295	601615	明阳智能	478,500	5,497,965.00	0.09
296	002008	大族激光	222,500	5,422,325.00	0.09
297	002271	东方雨虹	503,600	5,403,628.00	0.09
298	002405	四维图新	631,500	5,393,010.00	0.09
299	600845	宝信软件	228,079	5,387,225.98	0.09
300	600515	海南机场	1,519,000	5,377,260.00	0.09
301	601872	招商轮船	858,400	5,373,584.00	0.09
302	002459	晶澳科技	537,100	5,360,258.00	0.09
303	688266	泽璟制药	49,815	5,355,610.65	0.09
304	000426	兴业银锡	338,400	5,346,720.00	0.09
305	600895	张江高科	206,800	5,314,760.00	0.09
306	603087	甘李药业	96,800	5,302,704.00	0.09
307	300604	长川科技	117,500	5,276,925.00	0.09
308	300459	汤姆猫	942,300	5,276,880.00	0.09
309	300627	华测导航	150,760	5,276,600.00	0.09
310	603605	珀莱雅	63,400	5,248,886.00	0.08
311	600549	厦门钨业	250,400	5,238,368.00	0.08
312	603659	璞泰来	278,700	5,233,986.00	0.08
313	300012	华测检测	447,700	5,233,613.00	0.08
314	000733	振华科技	103,900	5,200,195.00	0.08
315	605117	德业股份	97,480	5,133,296.80	0.08
316	688599	天合光能	352,149	5,116,724.97	0.08
317	002155	湖南黄金	285,290	5,092,426.50	0.08
318	605589	圣泉集团	181,500	5,036,625.00	0.08
319	300037	新宙邦	142,900	5,030,080.00	0.08
320	300699	光威复材	158,700	5,026,029.00	0.08
321	600332	白云山	189,300	4,989,948.00	0.08
322	600392	盛和资源	378,500	4,984,845.00	0.08
323	300253	卫宁健康	469,300	4,974,580.00	0.08
324	601216	君正集团	891,600	4,921,632.00	0.08
325	688180	君实生物	144,524	4,910,925.52	0.08
326	000519	中兵红箭	223,600	4,894,604.00	0.08
327	000617	中油资本	668,700	4,881,510.00	0.08

328	300003	乐普医疗	354,100	4,879,498.00	0.08
329	002444	巨星科技	190,600	4,862,206.00	0.08
330	000932	华菱钢铁	1,099,900	4,839,560.00	0.08
331	601799	星宇股份	38,500	4,812,500.00	0.08
332	300316	晶盛机电	176,800	4,800,120.00	0.08
333	000878	云南铜业	376,400	4,787,808.00	0.08
334	002389	航天彩虹	186,900	4,784,640.00	0.08
335	300073	当升科技	108,900	4,777,443.00	0.08
336	600153	建发股份	459,700	4,767,089.00	0.08
337	002821	凯莱英	53,500	4,721,375.00	0.08
338	601233	桐昆股份	444,800	4,714,880.00	0.08
339	300001	特锐德	196,600	4,712,502.00	0.08
340	300628	亿联网络	135,200	4,699,552.00	0.08
341	300142	沃森生物	426,400	4,690,400.00	0.08
342	603979	金诚信	100,400	4,662,576.00	0.08
343	002414	高德红外	453,851	4,651,972.75	0.08
344	002812	恩捷股份	158,500	4,642,465.00	0.07
345	600803	新奥股份	245,200	4,634,280.00	0.07
346	300568	星源材质	362,200	4,592,696.00	0.07
347	600118	中国卫星	160,500	4,585,485.00	0.07
348	002152	广电运通	337,000	4,529,280.00	0.07
349	603260	合盛硅业	95,400	4,521,960.00	0.07
350	600177	雅戈尔	617,300	4,506,290.00	0.07
351	600699	均胜电子	257,900	4,497,776.00	0.07
352	002007	华兰生物	287,000	4,497,290.00	0.07
353	600521	华海药业	240,100	4,473,063.00	0.07
354	601238	广汽集团	593,000	4,441,570.00	0.07
355	600398	海澜之家	636,000	4,426,560.00	0.07
356	300413	芒果超媒	200,700	4,379,274.00	0.07
357	600704	物产中大	828,000	4,363,560.00	0.07
358	300315	掌趣科技	716,800	4,350,976.00	0.07
359	000623	吉林敖东	256,500	4,347,675.00	0.07
360	000738	航发控制	209,200	4,340,900.00	0.07
361	600316	洪都航空	115,000	4,335,500.00	0.07
362	600497	驰宏锌锗	818,900	4,331,981.00	0.07
363	002318	久立特材	185,200	4,331,828.00	0.07
364	002044	美年健康	833,900	4,286,246.00	0.07
365	600018	上港集团	748,000	4,271,080.00	0.07
366	600141	兴发集团	206,500	4,239,445.00	0.07
367	601567	三星医疗	189,000	4,237,380.00	0.07
368	600765	中航重机	250,100	4,221,688.00	0.07
369	000009	中国宝安	473,800	4,207,344.00	0.07
370	601677	明泰铝业	335,800	4,170,636.00	0.07

371	002409	雅克科技	76,100	4,161,909.00	0.07
372	000400	许继电气	191,100	4,160,247.00	0.07
373	300919	中伟股份	125,400	4,123,152.00	0.07
374	600038	中直股份	106,200	4,121,622.00	0.07
375	600637	东方明珠	546,100	4,079,367.00	0.07
376	300757	罗博特科	27,200	4,079,184.00	0.07
377	603939	益丰药房	165,800	4,057,126.00	0.07
378	300724	捷佳伟创	74,300	4,034,490.00	0.07
379	002607	中公教育	1,311,300	4,012,578.00	0.06
380	600498	烽火通信	190,400	4,004,112.00	0.06
381	000960	锡业股份	260,300	3,982,590.00	0.06
382	002407	多氟多	325,963	3,973,488.97	0.06
383	600529	山东药玻	179,400	3,971,916.00	0.06
384	601607	上海医药	220,900	3,949,692.00	0.06
385	002739	万达电影	345,100	3,944,493.00	0.06
386	688188	柏楚电子	29,875	3,933,342.50	0.06
387	300558	贝达药业	67,800	3,929,010.00	0.06
388	300088	长信科技	659,200	3,928,832.00	0.06
389	600563	法拉电子	35,900	3,916,331.00	0.06
390	002841	视源股份	112,400	3,889,040.00	0.06
391	600026	中远海能	375,900	3,883,047.00	0.06
392	300182	捷成股份	703,800	3,877,938.00	0.06
393	002245	蔚蓝锂芯	301,600	3,869,528.00	0.06
394	000039	中集集团	487,400	3,830,964.00	0.06
395	300068	南都电源	238,000	3,788,960.00	0.06
396	601018	宁波港	1,033,900	3,784,074.00	0.06
397	002025	航天电器	73,500	3,778,635.00	0.06
398	600486	扬农化工	65,100	3,775,800.00	0.06
399	301358	湖南裕能	120,200	3,749,038.00	0.06
400	000887	中鼎股份	210,600	3,704,454.00	0.06
401	300763	锦浪科技	64,200	3,684,438.00	0.06
402	300285	国瓷材料	211,800	3,674,730.00	0.06
403	688303	大全能源	171,623	3,659,002.36	0.06
404	600820	隧道股份	592,300	3,613,030.00	0.06
405	300144	宋城演艺	418,900	3,581,595.00	0.06
406	600008	首创环保	1,179,100	3,560,882.00	0.06
407	688009	中国通号	690,481	3,549,072.34	0.06
408	603806	福斯特	273,100	3,539,376.00	0.06
409	600516	方大炭素	761,500	3,533,360.00	0.06
410	300296	利亚德	577,600	3,523,360.00	0.06
411	002064	华峰化学	531,100	3,510,571.00	0.06
412	603568	伟明环保	182,400	3,480,192.00	0.06
413	603486	科沃斯	59,600	3,470,508.00	0.06

414	600763	通策医疗	83,958	3,465,786.24	0.06
415	600998	九州通	668,200	3,434,548.00	0.06
416	002497	雅化集团	300,100	3,421,140.00	0.06
417	600170	上海建工	1,429,600	3,416,744.00	0.06
418	600166	福田汽车	1,260,600	3,416,226.00	0.06
419	002312	川发龙蟒	295,200	3,388,896.00	0.05
420	601179	中国西电	548,900	3,370,246.00	0.05
421	600208	衢州发展	1,131,600	3,349,536.00	0.05
422	603816	顾家家居	131,000	3,343,120.00	0.05
423	600312	平高电气	216,200	3,327,318.00	0.05
424	000683	博源化工	692,500	3,317,075.00	0.05
425	605358	立昂微	142,000	3,308,600.00	0.05
426	002244	滨江集团	336,200	3,277,950.00	0.05
427	000818	航锦科技	145,500	3,273,750.00	0.05
428	601155	新城控股	238,700	3,265,416.00	0.05
429	002176	江特电机	448,800	3,258,288.00	0.05
430	300676	华大基因	65,200	3,245,004.00	0.05
431	601000	唐山港	796,900	3,235,414.00	0.05
432	603613	国联股份	135,300	3,205,257.00	0.05
433	000708	中信特钢	271,400	3,191,664.00	0.05
434	300567	精测电子	52,641	3,190,571.01	0.05
435	000830	鲁西化工	307,600	3,168,280.00	0.05
436	600323	瀚蓝环境	130,100	3,167,935.00	0.05
437	000629	钒钛股份	1,228,200	3,144,192.00	0.05
438	002432	九安医疗	86,200	3,140,266.00	0.05
439	603885	吉祥航空	232,200	3,127,734.00	0.05
440	002439	启明星辰	195,400	3,124,446.00	0.05
441	002603	以岭药业	221,100	3,117,510.00	0.05
442	600535	天士力	198,700	3,109,655.00	0.05
443	603000	人民网	152,200	3,075,962.00	0.05
444	300390	天华新能	159,200	3,035,944.00	0.05
445	601880	辽港股份	2,008,100	3,012,150.00	0.05
446	688005	容百科技	133,552	2,980,880.64	0.05
447	000563	陕国投 A	822,600	2,936,682.00	0.05
448	600004	白云机场	321,300	2,923,830.00	0.05
449	600499	科达制造	298,000	2,920,400.00	0.05
450	600655	豫园股份	525,700	2,917,635.00	0.05
451	600859	王府井	209,000	2,903,010.00	0.05
452	603077	和邦生物	1,657,800	2,901,150.00	0.05
453	002145	中核钛白	698,600	2,899,190.00	0.05
454	000547	航天发展	345,000	2,898,000.00	0.05
455	600131	国网信通	162,600	2,878,020.00	0.05
456	600325	华发股份	588,700	2,866,969.00	0.05

457	601966	玲珑轮胎	194,300	2,850,381.00	0.05
458	300529	健帆生物	132,100	2,849,397.00	0.05
459	603899	晨光股份	98,100	2,843,919.00	0.05
460	600511	国药股份	97,500	2,843,100.00	0.05
461	603833	欧派家居	49,400	2,788,630.00	0.05
462	002756	永兴材料	86,800	2,755,900.00	0.04
463	600754	锦江酒店	121,700	2,730,948.00	0.04
464	300601	康泰生物	178,700	2,714,453.00	0.04
465	000998	隆平高科	271,400	2,673,290.00	0.04
466	300751	迈为股份	37,700	2,622,412.00	0.04
467	300070	碧水源	581,600	2,617,200.00	0.04
468	600667	太极实业	396,700	2,610,286.00	0.04
469	601866	中远海发	1,056,500	2,609,555.00	0.04
470	300438	鹏辉能源	93,600	2,584,296.00	0.04
471	002120	韵达股份	384,600	2,576,820.00	0.04
472	002544	普天科技	109,700	2,572,465.00	0.04
473	600258	首旅酒店	180,200	2,546,226.00	0.04
474	600867	通化东宝	307,000	2,517,400.00	0.04
475	000032	深桑达 A	121,200	2,451,876.00	0.04
476	300457	赢合科技	105,300	2,421,900.00	0.04
477	000069	华侨城 A	1,075,310	2,419,447.50	0.04
478	300573	兴齐眼药	46,560	2,411,342.40	0.04
479	002508	老板电器	125,600	2,387,656.00	0.04
480	000967	盈峰环境	340,000	2,363,000.00	0.04
481	300118	东方日升	242,800	2,326,024.00	0.04
482	002831	裕同科技	99,300	2,325,606.00	0.04
483	002292	奥飞娱乐	235,500	2,289,060.00	0.04
484	600129	太极集团	103,600	2,207,716.00	0.04
485	002572	索菲亚	155,000	2,171,550.00	0.04
486	601636	旗滨集团	424,600	2,127,246.00	0.03
487	002266	浙富控股	683,900	2,106,412.00	0.03
488	603650	彤程新材	64,300	2,067,245.00	0.03
489	688063	派能科技	44,359	1,999,703.72	0.03
490	000035	中国天楹	466,100	1,999,569.00	0.03
491	300769	德方纳米	60,500	1,997,710.00	0.03
492	600864	哈投股份	334,000	1,993,980.00	0.03
493	688390	固德威	44,285	1,924,183.25	0.03
494	600315	上海家化	89,400	1,883,658.00	0.03
495	002091	江苏国泰	258,860	1,881,912.20	0.03
496	002372	伟星新材	173,900	1,801,604.00	0.03
497	001914	招商积余	115,100	1,423,787.00	0.02
498	600007	中国国贸	52,800	1,086,624.00	0.02
499	600335	国机汽车	166,100	1,071,345.00	0.02

500	301381	赛维时代	31,000	618,450.00	0.01
-----	--------	------	--------	------------	------

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

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	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
2	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
3	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
4	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
5	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
6	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
7	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
8	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
9	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	162,031,455.90	1.64
2	601318	中国平安	55,950,503.30	0.57
3	600036	招商银行	50,494,555.78	0.51
4	601166	兴业银行	43,733,096.00	0.44
5	688041	海光信息	39,470,877.65	0.40
6	600900	长江电力	36,268,697.00	0.37
7	601899	紫金矿业	25,918,662.46	0.26
8	600030	中信证券	25,247,133.30	0.26
9	688981	中芯国际	25,127,930.84	0.25
10	601328	交通银行	24,353,510.93	0.25
11	601398	工商银行	23,619,608.00	0.24
12	600276	恒瑞医药	23,128,694.60	0.23
13	688008	澜起科技	18,050,812.49	0.18
14	600887	伊利股份	17,029,191.00	0.17
15	601288	农业银行	16,565,498.00	0.17
16	601816	京沪高铁	16,504,707.00	0.17
17	600919	江苏银行	14,939,302.50	0.15
18	603259	药明康德	12,833,444.84	0.13
19	601127	赛力斯	12,679,927.00	0.13
20	601006	大秦铁路	12,593,879.00	0.13

注：“买入金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

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	600519	贵州茅台	326,752,693.80	3.31
2	601318	中国平安	147,627,618.06	1.49
3	600036	招商银行	139,198,854.27	1.41
4	600900	长江电力	93,060,759.00	0.94
5	601166	兴业银行	82,859,656.00	0.84
6	601899	紫金矿业	73,098,132.67	0.74
7	600030	中信证券	68,313,684.73	0.69
8	688041	海光信息	65,237,140.58	0.66
9	601398	工商银行	63,229,516.73	0.64
10	600276	恒瑞医药	58,811,026.96	0.60
11	688981	中芯国际	57,023,342.83	0.58
12	600887	伊利股份	47,257,235.00	0.48
13	601328	交通银行	45,197,734.35	0.46
14	601816	京沪高铁	44,080,988.01	0.45
15	601288	农业银行	43,787,744.00	0.44
16	601988	中国银行	40,916,739.00	0.41
17	603259	药明康德	38,899,447.47	0.39
18	600919	江苏银行	37,927,885.26	0.38
19	600000	浦发银行	32,878,609.77	0.33
20	688008	澜起科技	32,432,355.09	0.33

注：“卖出金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

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	1,797,262,596.47
卖出股票收入（成交）总额	3,962,624,686.15

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期不存在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是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的情形。

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	-
2	应收清算款	801,088.30
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	801,088.30

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

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	占基金资产净	流通受限情况说
----	------	------	----------	--------	---------

			允价值	值比例（%）	明
1	301678	新恒汇	17,014.28	0.00	新股流通受限
2	001388	信通电子	15,385.54	0.00	新股流通受限
3	301590	优优绿能	10,182.04	0.00	新股流通受限
4	301658	首航新能	10,042.26	0.00	新股流通受限
5	603014	威高血净	6,699.40	0.00	新股流通受限

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可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 （户）	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例（%）	持有份额	占总份额比 例（%）
23,094	274,447.34	5,357,095,167.00	84.52	980,991,674.00	15.48

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例（%）
中信建投证券股份有限公司 —银华中证 A500 交易型开 放式指数证券投资基金发起 式联接基金	1,888,784,682.00	29.80

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	中国人寿保险股份有 限公司	766,502,627.00	12.09
2	银华基金—中国人寿 保险股份有限公司— 分红险—银华基金国 寿股份均衡股票型组 合单一资产管理计划 （可供出售）	277,238,801.00	4.37
3	银华基金—中国人寿 保险股份有限公司— 分红险—银华基金国 寿股份成长股票型组 合单一资产管理计划	244,053,700.00	3.85

	(可供出售)		
4	银华基金－中国人寿保险股份有限公司－传统险－银华基金国寿股份均衡股票传统可供出售单一资产管理计划	227,175,460.00	3.58
5	申万宏源证券有限公司	207,352,895.00	3.27
6	国泰海通证券股份有限公司	166,400,160.00	2.63
7	中信保诚人寿保险有限公司－成长先锋投资账户	128,723,800.00	2.03
8	银华基金－中国人寿保险股份有限公司－传统险－银华基金国寿股份成长股票传统可供出售单一资产管理计划	116,043,000.00	1.83
9	中国平安人寿保险股份有限公司－寿险传统低－自主	103,626,900.00	1.63
10	西南证券股份有限公司	103,501,429.00	1.63
11	中信建投证券股份有限公司－银华中证A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1,888,784,682.00	29.80

注：以上信息中持有人名称及持有份额数量由中国证券登记结算有限责任公司提供。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：截至本报告期末，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

注：截至本报告期末，本基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 0；本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2024 年 9 月 26 日） 基金份额总额	2,000,086,841.00
------------------------------------	------------------

本报告期期初基金份额总额	10,265,086,841.00
本报告期基金总申购份额	2,187,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	6,114,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	6,338,086,841.00

§ 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，无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本基金管理人于 2025 年 4 月 26 日发布关于公司副总经理任职的公告，经本基金管理人董事会审议通过，徐波先生自 2025 年 4 月 24 日起担任本基金管理人副总经理职务。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金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

本基金的审计机构是安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

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，基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	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 (%)	
广发证券	5	5,759,523,866.08	100.00	840,325.79	100.00	-

注：1、公司选择证券公司参与证券交易的标准为：（1）具备为公募基金提供交易服务、研究服务所需的业务资格。（2）财务状况良好，经营行为规范。（3）建立并具有健全的合规风控制度。（4）具有较强的交易服务能力、研究服务能力。

2、公司将参与证券交易的合作券商分为普通合作券商和重点合作券商两类。其中，普通合作券商应具备较强的交易服务能力；重点合作券商除需满足具备较强的交易服务能力要求外，还需具备较强的研究服务能力。

3、符合以上标准的证券公司可向公司提出准入申请，并按要求提交相关材料。公司对证券公司提交的材料依次开展初审评估、评审会评审及公司领导审批，通过评审及审批的证券公司方可获得证券交易参与资格。

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	
	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 (%)
广发证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《银华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 4 季度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 1 月 21 日
2	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2024 年第 4 季度报告提示性公告》	四大证券报	2025 年 1 月 21 日
3	《银华基金管理股份有限公司关于指定旗下银华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金主流动性服务商的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上海证券报	2025 年 1 月 24 日
4	《银华基金管理股份有限公司关于指定旗下部分基金主流动性服务商的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上海证券报, 证券	2025 年 2 月 26 日

		时报	
5	《银华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年年度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 3 月 28 日
6	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2024 年年度报告提示性公告》	四大证券报	2025 年 3 月 28 日
7	《关于银华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上海证券报	2025 年 4 月 11 日
8	《银华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 1 季度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 4 月 21 日
9	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2025 年第 1 季度报告提示性公告》	四大证券报	2025 年 4 月 21 日
10	《关于银华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上海证券报	2025 年 6 月 24 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20250101-20250630	2,704,003,282.00	175,428,300.00	990,646,900.00	1,888,784,682.00	29.80
产品特有风险							
投资人在投资本基金时，将面临本基金的特定风险，具体包括： 1) 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对重大事项进行投票表决时可能拥有较大话语权； 2) 在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止或与其他基金合并或转型为另外的基金，其他基金份额持有人丧失继续投资本基金的机会； 3) 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额； 4) 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金的收益水平发生波动。同时，巨额赎回、份额净值小数保留位数是采用四舍五入、管理费及托管费等费用是按前一日资产计提，会导致基金份额净值出现大幅波动；							

5) 当某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模的 50%时, 本基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。在其他基金份额持有人赎回基金份额导致某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模 50%的情况下, 该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及转换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模的 50%, 该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 12.1.1 银华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金募集申请获中国证监会注册的文件
- 12.1.2 《银华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
- 12.1.3 《银华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 12.1.4 《银华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 12.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》
- 12.1.6 银华基金管理股份有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程
- 12.1.7 基金托管人业务资格批件和营业执照

12.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人或基金托管人的办公场所。本报告存放在本基金管理人及托管人住所, 供公众查阅、复制。

12.3 查阅方式

投资者可免费查阅, 在支付工本费后, 可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件, 投资者还可在本基金管理人网站 (www.yhfund.com.cn) 查阅。

银华基金管理股份有限公司

2025 年 8 月 29 日