交银施罗德中证A500指数型证券投资基金
2026年中期报告

2026年6月30日

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2026年8月31日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 28 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 2026 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 9
4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 11
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 12
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 12
§5 托管人报告 12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 12
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 12
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 13
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 13
6.1 资产负债表 13
6.2 利润表 14
6.3 净资产变动表 15
6.4 报表附注 17
§7 投资组合报告 42
7.1 期末基金资产组合情况 42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 58
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 58
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 58
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 58

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 58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 58
7.12 投资组合报告附注 59

§8 基金份额持有人信息 60

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 60
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 60
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 60

§9 开放式基金份额变动 61

§10 重大事件揭示 61

10.1 基金份额持有人大会决议 61
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 61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 61
10.4 基金投资策略的改变 61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 62
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 62
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 62
10.8 其他重大事件 63

§11 影响投资者决策的其他重要信息 64

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 64
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 64

§12 备查文件目录 64

12.1 备查文件目录 64
12.2 存放地点 64
12.3 查阅方式 64

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	交银施罗德中证 A500 指数型证券投资基金	
基金简称	交银中证 A500 指数	
基金主代码	023022	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 1 月 22 日	
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	180,943,004.29 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	交银中证 A500 指数 A	交银中证 A500 指数 C
下属分级基金的交易代码	023022	023023
报告期末下属分级基金的份额总额	118,556,200.78 份	62,386,803.51 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证 A500 指数，追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。在正常市场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 当指数编制方法变更、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量调整而发生变化、成份股派发现金股息、配股及增发、股票长期停牌、市场流动性不足等情况发生时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率×95%＋人民币银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金是一只股票型基金，其预期风险和预期收益理论上高于混合型基金、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中证 A500 指数，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		交银施罗德基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露	姓名	王晚婷	张姗
	联系电	（021）61055050	400-61-95555

负责人	话		
	电子邮箱	xxpl@jysld.com,disclosure@jysld.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-700-5000，021-61055000	400-61-95555
传真		（021）61055054	0755-83195201
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号交通银行大楼二层（裙）	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		上海市浦东新区世纪大道8号国金中心二期21-23楼	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		200120	518040
法定代表人		袁庆伟	缪建民

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》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.fund001.com
基金中期报告置备地点	基金管理人的办公场所

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(2026年1月1日-2026年6月30日)	
	交银中证A500指数A	交银中证A500指数C
本期已实现收益	6,117,403.65	2,423,634.01
本期利润	18,796,427.11	8,175,765.48
加权平均基金份额本期利润	0.1616	0.1694
本期加权平均净值利润率	12.41%	13.04%
本期基金份额净值增长率	13.47%	13.37%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026年6月30日)	

期末可供分配利润	16,629,443.46	8,584,030.38
期末可供分配基金份额利润	0.1403	0.1376
期末基金资产净值	166,104,080.60	87,218,583.29
期末基金份额净值	1.4011	1.3980
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	40.11%	39.80%

注：1、上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，计入费用后的实际收益水平要低于所列数字；

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

3.2 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

交银中证 A500 指数 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	15.34%	1.31%	13.54%	1.34%	1.80%	-0.03%
过去六个月	13.47%	1.20%	11.34%	1.22%	2.13%	-0.02%
过去一年	38.49%	1.07%	34.41%	1.09%	4.08%	-0.02%
自基金合同生效起至今	40.11%	1.03%	37.95%	1.07%	2.16%	-0.04%

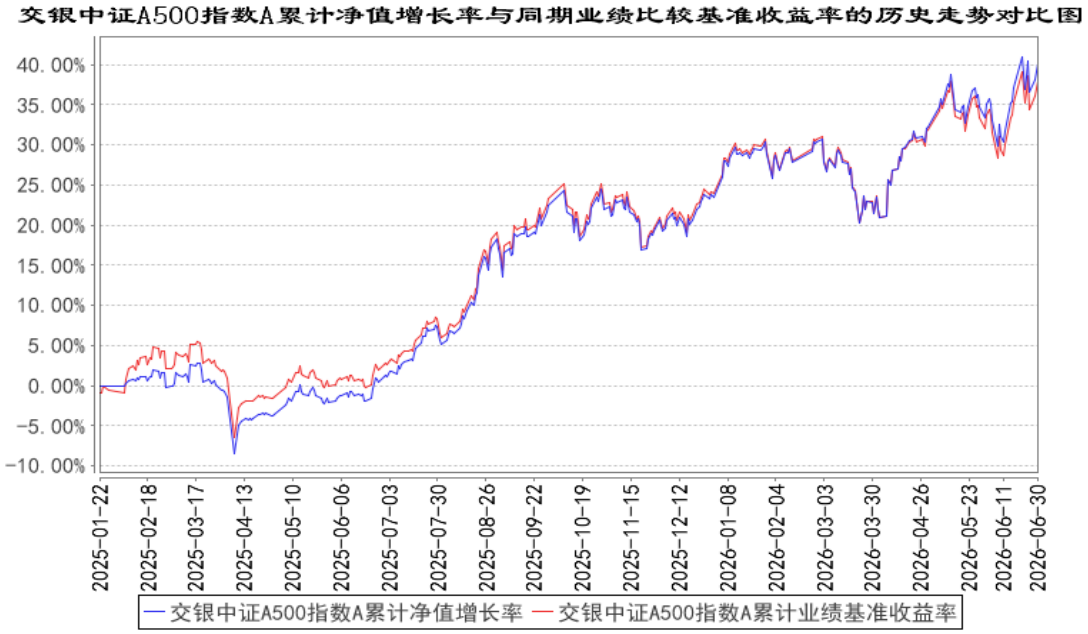
交银中证 A500 指数 C

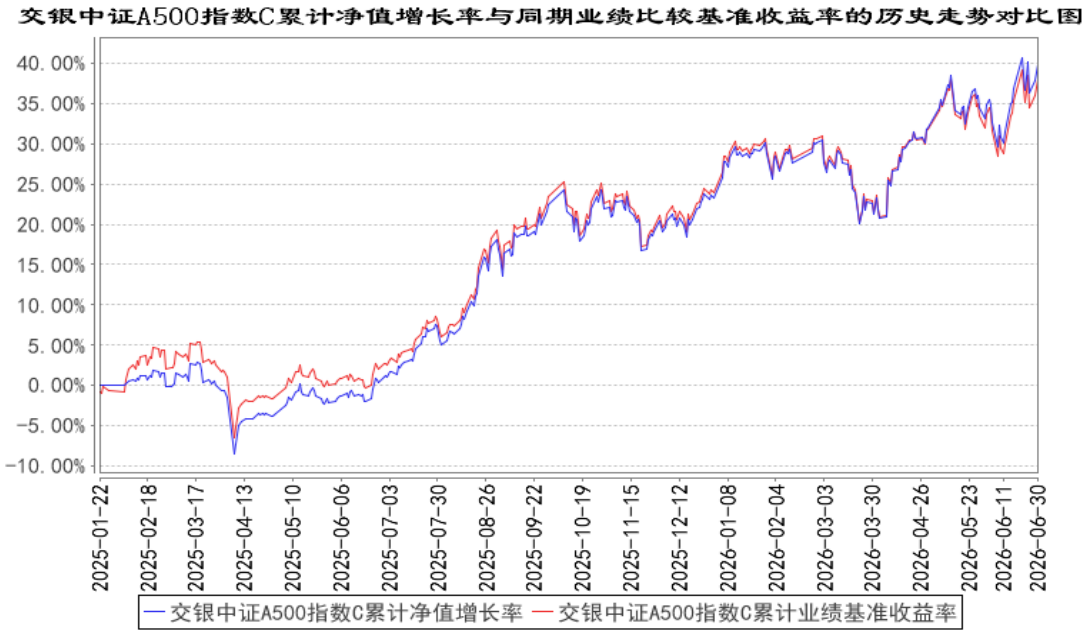
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	15.29%	1.31%	13.54%	1.34%	1.75%	-0.03%
过去六个月	13.37%	1.20%	11.34%	1.22%	2.03%	-0.02%
过去一年	38.28%	1.07%	34.41%	1.09%	3.87%	-0.02%
自基金合同生效	39.80%	1.03%	37.95%	1.07%	1.85%	-0.04%

起至今						

注：本基金的业绩比较基准为中证 A500 指数收益率×95%＋人民币银行活期存款利率（税后）×5%，每日进行再平衡过程。

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：本基金基金合同生效日为 2025 年 1 月 22 日，截至报告期期末，本基金已完成建仓但报告期期末距建仓结束未满一年。本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

§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

交银施罗德基金管理有限公司是经中国证监会证监基金字[2005]128 号文批准，由交通银行股份有限公司、施罗德投资管理有限公司、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司共同发起设立。公司成立于 2005 年 8 月 4 日，注册地在中国上海，注册资本金为 2 亿元人民币。其中，交通银行股份有限公司持有 65%的股份，施罗德投资管理有限公司持有 30%的股份，中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司持有 5%的股份。公司并下设交银施罗德资产管理有限公司。

截至报告期末，公司管理了包括货币型、债券型、混合型和股票型在内的 148 只基金，其中股票型涵盖普通指数型、交易型开放式（ETF）、QDII 等不同类型基金。

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		
邵文婷	基金经理、多资产研究部副总监	2025 年 1 月 22 日	-	10 年	硕士。2016 年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任量化投资部研究员/投资经理。

注：1、本表所列基金经理（助理）任职日期和离职日期均以基金合同生效日或公司作出决定并公告(如适用)之日为准。

2、本表所列基金经理（助理）证券从业年限中的“证券从业”的含义遵从中国证券业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、基金经理（或基金经理小组）期后变动（如有）敬请关注基金管理人发布的相关公告。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定及基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本公司制定了严格的投资控制制度和公平交易监控制度来保证旗下基金运作的公平，旗下所管理的所有资产组合，包括证券投资基金和私募资产管理计划均严格遵循制度进行公平交易。

公司建立资源共享的投资研究信息平台，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施

投资决策方面享有公平的机会。公司在交易执行环节实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度。对于交易所公开竞价交易，遵循“价格优先、时间优先”的原则，全部通过交易系统进行比例分配；对于非集中竞价交易、以公司名义进行的场外交易，遵循公平交易分配原则对交易结果进行分配。

公司中央交易室和风险管理部进行日常投资交易行为监控，风险管理部负责对各账户公平交易进行事后分析，于每季度和每年度分别对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，本公司管理的所有投资组合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没有超过该证券当日总成交量5%的情形，本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差未出现异常。

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

2026年上半年，国内经济延续修复态势但弹性有限，财政政策超预期发力对冲货币政策的审慎转向，市场在内生修复与外部扰动间寻求平衡，A股呈现“一季度宽幅震荡、二季度科技产业链引领上涨”的格局。上半年制造业景气度先抑后稳：1月受淡季效应和需求不足影响，PMI回落至荣枯线下；2月春节假期压缩生产节奏，PMI进一步收缩至49.0%；3-6月景气企稳，制造业PMI在荣枯线附近窄幅波动，但整体扩张力度有限。非制造业景气度波折回升：3月服务业随春节消费回暖呈现季节性走强，带动非制造业商务活动指数重返扩张区间；4月受季节性因素影响商务活动指数一度回落至49.4%的年内低点；5月、6月逐月改善，连续回升至扩张区间。流动性方面，上半年十年期国债收益率呈波动下行态势，由年初的1.84%降至6月末的1.73%，资金面维持合理充裕。货币政策方面，央行年初明确“降准降息有一定空间”，但表述从“适时降准降息”调整为“灵活高效运用降准降息等多种政策工具”，显示总量宽松节奏趋缓、更注重相机抉择；二季度未实施全面降准降息，政策重心转向结构性与精准投放，呈现“价”端宽松、“量”端收敛的特征；社融信贷月度节奏亦不均衡，4月双双走弱、5月大幅反弹，反映宽松更趋相机而非总量发力。政策方面，一季度以顶层定调为主，3月全国两会明确经济增速目标4.5%-5%，宏观政策延续“更加

积极的财政政策+适度宽松的货币政策”框架，同时强调发挥存量与增量政策集成效应，加大逆周期和跨周期调节力度。政府工作报告重点部署扩内需、促消费、城乡居民增收及新质生产力培育等方向，为全年政策路径提供指引。二季度政策进入执行落地阶段，4 月中央政治局会议重提“做强国内大循环、做优国内国际双循环”，提出加强“六网”建设，部署服务业扩能提质、推动条件成熟的重大工程开工、保持制造业合理比重，表明政策进入以具体抓手推进执行的新阶段。

回顾上半年市场行情，A 股呈现极致的结构性分化，AI 算力产业链全面爆发，周期消费承压：科创 50 以 64%的涨幅遥遥领先，创业板 50 涨超 37%，而代表大盘整体的上证指数仅上涨 3.2%。从节奏上看，年初市场以科技为主线，上证指数再度站上关键整数关口，A 股成交额屡创新高；进入 3 月，受地缘冲突升级影响，全球风险偏好回落，A 股承压震荡，能源、金融等高股息板块逆势上涨；4 月中旬中东局势出现缓和，叠加国内“十五五”规划落地、政治局会议释放积极信号，市场展开超跌修复；5 月随着年报和一季报披露完毕，科技成长板块的业绩高增长得到验证，市场从估值修复切换至盈利驱动，5 月中旬上证指数触及季度高点；6 月双创指数创出历史新高后，获利盘兑现意愿增强，市场进入高位震荡，板块内部轮动加速。作为跟踪基准指数的指数基金，本基金上半年总体呈现先下行、后震荡上行态势。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金（各类）份额净值及业绩表现请见“3.1 主要会计数据和财务指标”及“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”部分披露。

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 2026 年下半年，国内政策执行已进入深水区，财政发力的方向性判断得到验证；经济基本面企稳向好的方向预计延续，但弹性仍待观察。往后可重点关注下半年专项债与特别国债剩余额度的发行节奏，以及总量货币宽松情况。政策方面，鉴于二季度政府债券与“两重”资金下达节奏靠前，预计下半年发行将延续“前快后稳”，下半年财政发力的边际增量将更多体现在存量项目的资金落地与实物工作量形成，而非新增额度的进一步加码。产业政策方面，“未来产业”已从顶层设计加速进入中观执行：人工智能领域“人工智能+”行动配套文件持续落地，制造、医疗、能源等十余个行业专项指导文件相继推出并布局应用中试基地；具身智能、脑机接口加速产业化；6G 通信被纳入“六网”中的“新一代通信网”统筹规划。前沿领域政策已从方向性部署转向行业细则与地方配套，为下半年科技成长主线的持续性提供支撑。流动性方面，资本市场制度建设进一步引导中长期资金入市，将社保基金、养老保险、企业年金、保险资金、公募基金、银行理财等六大类长期资金纳入战略投资者范围，并设定持股比例与限售期安排。保险、年金等长钱配置力量正逐步成为 A 股流动性的主要边际增量来源。交易节奏上，三季度进入中报披露期，科技成

长主线仍是业绩与主题共振较强的方向，预计将维持主导；顺周期有望受益于财政拨付加快，但业绩验证尚不及科技链，配置宜审慎；消费修复存在阶段性机会但弹性有限。总体而言，从中长期来看，我们对 A 股市场维持谨慎乐观的看法。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。本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。

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理层批准后实行，并成立了估值委员会，估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。估值委员会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后，及时召开临时会议进行研究，及时修订估值方法，以保证其持续适用。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金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

本基金本报告期内无需预警说明。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产

品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：交银施罗德中证 A500 指数型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	20,344,271.70	14,288,478.90
结算备付金		61,938.69	27,493.22
存出保证金		22,079.07	24,814.72
交易性金融资产	6.4.7.2	235,999,889.06	161,510,629.55
其中：股票投资		235,975,888.42	159,373,216.34
基金投资		-	-
债券投资		24,000.64	2,137,413.21
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,169,570.00	542,770.21
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		257,597,748.52	176,394,186.60
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026 年 6 月 30 日**	**上年度末 2025 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		3,427,689.83	3,353.96
应付赎回款		710,652.50	6,266,454.11
应付管理人报酬		28,762.51	21,367.28
应付托管费		9,587.51	7,122.43
应付销售服务费		9,374.09	6,539.59
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.05	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	89,018.14	153,369.21
负债合计		4,275,084.63	6,458,206.58
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	180,943,004.29	137,676,825.19
未分配利润	6.4.7.12	72,379,659.60	32,259,154.83
净资产合计		253,322,663.89	169,935,980.02
负债和净资产总计		257,597,748.52	176,394,186.60

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 180,943,004.29 份，其中交银中证 A500 指数 A 基金份额总额 118,556,200.78 份，基金份额净值 1.4011 元；交银中证 A500 指数 C 基金份额总额 62,386,803.51 份，基金份额净值 1.3980 元。

6.2 利润表

会计主体：交银施罗德中证 A500 指数型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 22 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		27,313,618.64	8,345,660.43
1.利息收入		29,437.21	616,988.12
其中：存款利息收入	6.4.7.13	29,437.21	117,341.29
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		-	499,646.83
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		8,840,273.01	5,111,337.27
其中：股票投资收益	6.4.7.14	6,921,108.70	2,726,278.42
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	43,569.95	16.46

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	1,875,594.36	2,385,042.39
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	18,431,154.93	2,617,051.31
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	12,753.49	283.73
减：二、营业总支出		341,426.05	423,016.07
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	159,116.55	208,186.63
2．托管费	6.4.10.2.2	53,038.85	69,395.56
3．销售服务费	6.4.10.2.3	46,720.44	66,409.25
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		-	1,798.73
8．其他费用	6.4.7.23	82,550.21	77,225.90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		26,972,192.59	7,922,644.36
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		26,972,192.59	7,922,644.36
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		26,972,192.59	7,922,644.36

6.3 净资产变动表

会计主体：交银施罗德中证A500指数型证券投资基金

本报告期：2026年1月1日至2026年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026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	137,676,825.19	-	32,259,154.83	169,935,980.02
二、本期期初净资产	137,676,825.19	-	32,259,154.83	169,935,980.02
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	43,266,179.10	-	40,120,504.77	83,386,683.87
（一）、综合收益总额	-	-	26,972,192.59	26,972,192.59
（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）	43,266,179.10	-	13,148,312.18	56,414,491.28
其中：1.基金申购款	141,812,913.66	-	43,895,936.73	185,708,850.39
2.基金赎回款	-98,546,734.56	-	-30,747,624.55	-129,294,359.11
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	180,943,004.29	-	72,379,659.60	253,322,663.89

项目	上年度可比期间 2025年1月22日（基金合同生效日）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	-	-	-	-
二、本期期初净资产	640,369,795.25	-	-	640,369,795.25
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	- 407,378,342.63	-	2,680,564.64	-404,697,777.99
（一）、综合收益总额	-	-	7,922,644.36	7,922,644.36
（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）	- 407,378,342.63	-	-5,242,079.72	-412,620,422.35
其中：1.基金申	100,061,998.00	-	-392,764.39	99,669,233.61

购款				
2.基金赎回款	-507,440,340.63	-	-4,849,315.33	-512,289,655.96
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	232,991,452.62	-	2,680,564.64	235,672,017.26

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：

袁庆伟	周云康	许颖
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

交银施罗德中证 A500 指数型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2024]1810 号《关于准予交银施罗德中证 A500 指数型证券投资基金注册的批复》准予注册，由交银施罗德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德中证 A500 指数型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 640,300,422.52 元，业经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)德师报(验)字(25)第 00018 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《交银施罗德中证 A500 指数型证券投资基金基金合同》于 2025 年 1 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 640,369,795.25 份基金份额，其中认购资金利息折合 69,372.73 份基金份额。本基金的基金管理人为交银施罗德基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《交银施罗德中证 A500 指数型证券投资基金基金合同》和《交银施罗德中证 A500 指数型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购、赎回时收取认购/申购、赎回费用且不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用、赎回时收取赎回费用，并从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、

C 类两种收费模式并存，各类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德中证 A500 指数型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括中证 A500 指数的成份股（含存托凭证）及备选成份股（含存托凭证）、其他股票（含创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（含国债、央行票据、金融债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换公司债券、次级债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、货币市场工具、债券回购、同业存单、银行存款（含协议存款、定期存款及其他银行存款）、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。本基金的投资组合比例为：本基金投资于中证 A500 指数成份股（含存托凭证）及备选成份股（含存托凭证）的比例不低于基金资产净值的 90%且不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证 A500 指数收益率×95%＋人民币银行活期存款利率（税后）×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司于 2026 年 8 月 28 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则——基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的《公开募集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》以及参考本基金的基金合同和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及其允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年上半年的经营成果和净资产变动情况。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%

的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	20,344,271.70
等于：本金	20,342,510.05
加：应计利息	1,761.65
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	20,344,271.70

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票		192,833,761.23	-	235,975,888.42	43,142,127.19
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	24,000.00	0.64	24,000.64	0.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	24,000.00	0.64	24,000.64	0.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		192,857,761.23	0.64	235,999,889.06	43,142,127.19

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

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 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

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

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

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3.86
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	15,089.92
其中：交易所市场	15,089.92
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	9,916.99
预提信息披露费	59,507.37
预提账户维护费	4,500.00
合计	89,018.14

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

交银中证 A500 指数 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	98,482,406.62	98,482,406.62
本期申购	66,949,984.75	66,949,984.75
本期赎回（以“-”号填列）	-46,876,190.59	-46,876,190.59
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	118,556,200.78	118,556,200.78

交银中证 A500 指数 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	39,194,418.57	39,194,418.57
本期申购	74,862,928.91	74,862,928.91
本期赎回（以“-”号填列）	-51,670,543.97	-51,670,543.97
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	62,386,803.51	62,386,803.51

注：1、如果本报告期间发生红利再投、转换入业务，则总申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

交银中证 A500 指数 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	8,676,361.80	14,448,017.69	23,124,379.49
本期期初	8,676,361.80	14,448,017.69	23,124,379.49
本期利润	6,117,403.65	12,679,023.46	18,796,427.11
本期基金份额交易产生的变动数	1,835,678.01	3,791,395.21	5,627,073.22
其中：基金申购款	7,038,169.66	13,898,415.68	20,936,585.34
基金赎回款	-5,202,491.65	-10,107,020.47	-15,309,512.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	16,629,443.46	30,918,436.36	47,547,879.82

交银中证 A500 指数 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,390,371.76	5,744,403.58	9,134,775.34
本期期初	3,390,371.76	5,744,403.58	9,134,775.34
本期利润	2,423,634.01	5,752,131.47	8,175,765.48
本期基金份额交易产生的变动数	2,770,024.61	4,751,214.35	7,521,238.96
其中：基金申购款	7,935,784.56	15,023,566.83	22,959,351.39
基金赎回款	-5,165,759.95	-10,272,352.48	-15,438,112.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,584,030.38	16,247,749.40	24,831,779.78

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
活期存款利息收入	29,078.00
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	202.39
其他	156.82
合计	29,437.21

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 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	6,921,108.70
股票投资收益——赎回差价收入	-
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	6,921,108.70

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 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出股票成交总额	40,542,233.38
减：卖出股票成本总额	33,567,940.36
减：交易费用	53,184.32
买卖股票差价收入	6,921,108.70

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

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

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	927.36
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	42,642.59
债券投资收益——赎回差价收入	-

债券投资收益——申购差价收入	-
合计	43,569.95

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,139,184.73
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,073,250.00
减：应计利息总额	23,287.48
减：交易费用	4.66
买卖债券差价收入	42,642.59

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

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

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

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

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

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

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

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,875,594.36
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,875,594.36

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	18,431,154.93
股票投资	18,472,948.63
债券投资	-41,793.70
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2.衍生工具	-
权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	18,431,154.93

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	12,753.49
合计	12,753.49

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25%归入基金资产。

2、本基金的赎回费收入包括转换费收入，其中转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的不低于赎回费的 25%归入转出基金的基金资产。

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	9,916.99
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	4,125.85
债券账户费用	9,000.00
合计	82,550.21

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、关联关系

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

本报告期内上海直源投资管理有限公司已完成工商注销登记。

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
交银施罗德基金管理有限公司(“交银施罗德基金公司”)	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	基金托管人、基金销售机构
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	基金管理人的股东、基金销售机构
中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司	基金管理人的股东

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 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

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 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月22日（基金合同生效日）至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	159,116.55	208,186.63
其中：应支付销售机构的客户维护费	73,318.92	103,582.67
应支付基金管理人的净管理费	85,797.63	104,603.96

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值×适用费率÷当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月22日（基金合同生效日）至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	53,038.85	69,395.56

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值×适用费率÷当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	交银中证 A500 指数 A	交银中证 A500 指数 C	合计
交通银行股份有限公司	-	30,279.47	30,279.47
交银施罗德基金管理有限公司	-	1,782.26	1,782.26
招商银行股份有限公司	-	5,997.51	5,997.51
合计	-	38,059.24	38,059.24
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 22 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	交银中证 A500 指数 A	交银中证 A500 指数 C	合计
交通银行股份有限公司	-	53,012.59	53,012.59
交银施罗德基金管理有限公司	-	345.37	345.37
招商银行股份有限公司	-	7,678.17	7,678.17
合计	-	61,036.13	61,036.13

注：支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日该类基金份额对应的基金资产净值约定的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

交银中证 A500 指数 A 类份额日基金销售服务费＝前一日交银中证 A500 指数 A 类基金份额对应的资产净值×0.00%÷当年天数；

交银中证 A500 指数 C 类份额日基金销售服务费＝前一日交银中证 A500 指数 C 类基金份额对应的资产净值×0.15%÷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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	交银中证 A500 指数 A	交银中证 A500 指数 C
基金合同生效日（ 2025 年 1 月 22 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	25,063,915.11	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	25,063,915.11	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	13.85%	-
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 22 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	交银中证 A500 指数 A	交银中证 A500 指数 C
基金合同生效日（ 2025 年 1 月 22 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务。

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

3、基金管理人投资本基金适用的申购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月22日（基金合同生效日）至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行_活期存款	20,344,271.70	29,078.00	18,065,082.63	114,369.82

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，存款利率参考银行同业利率及银行存款利率确定。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期末，本基金（因指数成份股而被动）持有191,400.00股基金管理人股东交通银行股份有限公司的A股普通股，估值总额为人民币1,230,702.00元，占基金资产净值的比例为0.49%；本基金（因指数成份股而被动）持有88,800.00股基金托管人招商银行股份有限公司的A股普通股，估值总额为人民币3,152,400.00元，占本基金资产净值的比例为1.24%；本基金（因指数成份股而被动）持有13,200.00股基金管理人股东中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司的A股普通股，估值总额为人民币107,052.00元，占本基金资产净值的比例为0.04%。上述关联交易符合《基金合同》及相关法律法规的规定，不存在任何利益冲突或者损害持有人利益的情况。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2026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	成功认购	受限期	流通	认购价格	期末估值单价	数量（单	期末成本总额	期末估值总额	备注

	名称	日		受限类型			位：股）			
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月以上	限售股	28.00	27.78	46	1,288.00	1,277.88	-
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月以上	限售股	18.38	16.78	74	1,360.12	1,241.72	-
301513	尚水智能	2026 年 4 月 10 日	6 个月以上	限售股	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春光集团	2026 年 4 月 28 日	6 个月以上	限售股	13.30	51.56	260	3,458.00	13,405.60	-
301669	高特电子	2026 年 6 月 2 日	6 个月以上	限售股	7.08	28.40	448	3,171.84	12,723.20	-
301680	固德电材	2026 年 2 月 27 日	6 个月以上	限售股	58.00	112.16	64	3,712.00	7,178.24	-
301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	6 个月以上	限售股	78.38	121.77	50	3,919.00	6,088.50	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月以上	限售股	21.93	77.78	111	2,434.23	8,633.58	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月以上	限售股	24.68	86.80	135	3,331.80	11,718.00	-
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月以上	限售股	11.18	17.59	175	1,956.50	3,078.25	-

603284	林平发展	2026年2月3日	6个月以上	限售股	37.88	34.87	35	1,325.80	1,220.45	-
603293	埃泰克	2026年4月9日	6个月以上	限售股	33.49	33.93	42	1,406.58	1,425.06	-
603435	嘉德利	2026年5月15日	6个月以上	限售股	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026年3月31日	6个月以上	限售股	17.70	84.32	143	2,531.10	12,057.76	-
688635	长进光子	2026年5月20日	6个月以上	限售股	40.98	308.19	94	3,852.12	28,969.86	-
688785	恒运昌	2026年1月20日	6个月以上	限售股	92.18	463.15	44	4,055.92	20,378.60	-
688797	臻宝科技	2026年6月16日	6个月以上	限售股	44.56	468.67	83	3,698.48	38,899.61	-
688808	联讯仪器	2026年4月16日	6个月以上	限售股	81.88	1,584.33	47	3,848.36	74,463.51	-
688811	有研复材	2026年4月1日	6个月以上	限售股	6.41	24.13	652	4,179.32	15,732.76	-
688816	易思维	2026年2月4日	6个月以上	限售股	55.95	57.10	69	3,860.55	3,939.90	-
688820	盛合晶微	2026年4月13日	6个月以上	限售股	19.68	141.49	274	5,392.32	38,768.26	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
111025	圣泉转债	2026年6月26日	1个月内（含）	老股东配债	100.00	100.00	140	14,000.00	14,000.18	-
113704	春风转债	2026年6月11日	1个月内（含）	老股东配债	100.00	100.00	100	10,000.00	10,000.46	-

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
688072	拓荆科技	2026年6月29日	重大事项停牌	879.53	2026年7月13日	890.99	1,350	415,418.73	1,187,365.50	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于承担较高预期风险、预期收益较高的证券投资基金品种。本基金的投资范围为具有良好流动

性的金融工具，包括中证 A500 指数的成份股（含存托凭证）及备选成份股（含存托凭证）、其他股票（含创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（含国债、央行票据、金融债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换公司债券、次级债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、货币市场工具、债券回购、同业存单、银行存款（含协议存款、定期存款及其他银行存款）、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相关规定）。本基金绝大部分资产采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即按照中证 A500 指数中的成份股组成及其权重构建股票投资组合，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，或因某些特殊情况导致成份股流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立合规风险及审计委员会，负责对公司在经营管理和基金业务运作的合法性、合规性和风险状况进行检查和评估；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部负责协调并与各部门合作完成基金运作的风险管理。督察长直接对董事会负责，就内部控制制度和执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能，定期和不定期地向董事会报告公司内部控制执行情况。

本基金的基金管理人建立了以合规风险及审计委员会为核心的，由督察长、风险控制委员会、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

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。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，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应措施，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款

存放在本基金的托管行或其他国内大中型商业银行，按银行同业利率计息，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

本期末及上年度末，本基金未持有或持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例较低，因此信用风险对于本基金资产净值无重大影响。

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在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于报告期末，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其

他金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为货币资金、结算备付金、存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 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	20,344,271.70	-	-	-	20,344,271.70
结算备付金	61,938.69	-	-	-	61,938.69
存出保证金	22,079.07	-	-	-	22,079.07
交易性金融资产	-	-	24,000.64	235,975,888.42	235,999,889.06
应收申购款	160.00	-	-	1,169,410.00	1,169,570.00
资产总计	20,428,449.46	-	24,000.64	237,145,298.42	257,597,748.52
负债					
应付赎回款	-	-	-	710,652.50	710,652.50
应付管理人报酬	-	-	-	28,762.51	28,762.51
应付托管费	-	-	-	9,587.51	9,587.51
应付清算款	-	-	-	3,427,689.83	3,427,689.83
应付销售服务费	-	-	-	9,374.09	9,374.09
应交税费	-	-	-	0.05	0.05
其他负债	-	-	-	89,018.14	89,018.14
负债总计	-	-	-	4,275,084.63	4,275,084.63
利率敏感度缺口	20,428,449.46	-	24,000.64	232,870,213.79	253,322,663.89
上年度末 2025 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	14,288,478.90	-	-	-	14,288,478.90
结算备付金	27,493.22	-	-	-	27,493.22

存出保证金	24,814.72	-	-	-	24,814.72
交易性金融资产	2,022,310.14	-	115,103.07	159,373,216.34	161,510,629.55
应收申购款	31,101.00	-	-	511,669.21	542,770.21
资产总计	16,394,197.98	-	115,103.07	159,884,885.55	176,394,186.60
负债					
应付赎回款	-	-	-	6,266,454.11	6,266,454.11
应付管理人报酬	-	-	-	21,367.28	21,367.28
应付托管费	-	-	-	7,122.43	7,122.43
应付清算款	-	-	-	3,353.96	3,353.96
应付销售服务费	-	-	-	6,539.59	6,539.59
其他负债	-	-	-	153,369.21	153,369.21
负债总计	-	-	-	6,458,206.58	6,458,206.58
利率敏感度缺口	16,394,197.98	-	115,103.07	153,426,678.97	169,935,980.02

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予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本期末及上年度末持有的交易性债券投资比例较低，因此市场利率的变动对于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，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金绝大部分资产采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即按照中证A500指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，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，或因某些特殊情况导致成份股流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。基金的投资组合比例为：本基金投资于中证A500指数成份股（含存托凭证）及备选成份股（含存托凭证）的比例不低于基金资产净值的90%

且不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025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	235,975,888.42	93.15	159,373,216.34	93.78
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	24,000.64	0.01	115,103.07	0.07
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	235,999,889.06	93.16	159,488,319.41	93.85

注：债券投资为可转换债券或可交换债券投资。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 6.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末 （2025 年 12 月 31 日 ）
	1.业绩比较基准上涨 5%	12,423,094.09	-
	2.业绩比较基准下降 5%	-12,423,094.09	-

注：于 2025 年 12 月 31 日，由于本基金运行期间不足一年，尚不存在足够的经验数据，因此无法

对本基金资产净值对于其他价格风险的敏感性作定量分析。

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 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	234,475,431.86	158,374,104.72
第二层次	1,211,366.14	3,001,951.82
第三层次	313,091.06	134,573.01
合计	235,999,889.06	161,510,629.55

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。 对于公开市场交易的证券投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	235,975,888.42	91.61
	其中：股票	235,975,888.42	91.61
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	24,000.64	0.01
	其中：债券	24,000.64	0.01
	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	20,406,210.39	7.92
8	其他各项资产	1,191,649.07	0.46
9	合计	257,597,748.52	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	745,641.00	0.29
B	采矿业	9,761,489.50	3.85
C	制造业	166,409,059.51	65.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,174,043.00	2.04
E	建筑业	2,893,490.00	1.14
F	批发和零售业	1,807,887.00	0.71
G	交通运输、仓储和邮政业	5,288,488.00	2.09
H	住宿和餐饮业	109,984.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,020,186.15	5.14
J	金融业	23,020,671.00	9.09
K	房地产业	1,323,891.00	0.52

L	租赁和商务服务业	1,716,331.80	0.68
M	科学研究和技术服务业	2,835,455.00	1.12
N	水利、环境和公共设施管理业	407,129.40	0.16
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	79,560.00	0.03
Q	卫生和社会工作	463,092.00	0.18
R	文化、体育和娱乐业	181,517.00	0.07
S	综合	424,882.00	0.17
	合计	235,662,797.36	93.03

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	311,813.18	0.12
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	1,277.88	0.00
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	-	-
O	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	313,091.06	0.12

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	300308	中际旭创	8,000	10,160,000.00	4.01
2	300750	宁德时代	18,900	7,427,889.00	2.93
3	300502	新易盛	9,944	6,036,008.00	2.38
4	600519	贵州茅台	4,400	5,216,156.00	2.06
5	603986	兆易创新	4,700	3,830,500.00	1.51
6	601318	中国平安	76,400	3,647,336.00	1.44
7	688256	寒武纪	2,169	3,460,747.95	1.37
8	600036	招商银行	88,800	3,152,400.00	1.24
9	601899	紫金矿业	118,200	2,971,548.00	1.17
10	002371	北方华创	3,050	2,697,908.00	1.07
11	000333	美的集团	34,800	2,628,444.00	1.04
12	002475	立讯精密	36,500	2,569,600.00	1.01
13	688008	澜起科技	8,153	2,526,614.70	1.00
14	688012	中微公司	5,331	2,497,573.50	0.99
15	688041	海光信息	6,567	2,431,760.10	0.96
16	002384	东山精密	9,100	2,387,385.00	0.94
17	600900	XD 长江电	87,700	2,321,419.00	0.92
18	688981	中芯国际	14,490	2,301,301.80	0.91
19	000725	京东方 A	260,800	2,263,744.00	0.89
20	603259	药明康德	17,700	2,203,827.00	0.87
21	600030	中信证券	70,000	2,011,100.00	0.79
22	601166	兴业银行	121,400	2,010,384.00	0.79
23	300059	东方财富	90,800	1,850,504.00	0.73
24	600183	生益科技	10,400	1,803,360.00	0.71
25	600276	恒瑞医药	31,949	1,662,625.96	0.66
26	300274	阳光电源	10,400	1,653,808.00	0.65
27	601398	工商银行	232,100	1,640,947.00	0.65
28	300408	三环集团	9,600	1,602,240.00	0.63
29	002594	比亚迪	19,400	1,546,180.00	0.61
30	600487	亨通光电	14,100	1,541,694.00	0.61

31	300476	胜宏科技	4,300	1,489,649.00	0.59
32	601211	国泰海通	81,000	1,474,200.00	0.58
33	002463	沪电股份	9,600	1,466,880.00	0.58
34	300394	天孚通信	4,632	1,402,013.76	0.55
35	000988	华工科技	7,200	1,329,192.00	0.52
36	688498	源杰科技	679	1,280,594.00	0.51
37	688525	佰维存储	2,574	1,273,435.02	0.50
38	301308	江波龙	1,800	1,266,840.00	0.50
39	600176	中国巨石	17,200	1,253,536.00	0.49
40	601288	农业银行	206,100	1,251,027.00	0.49
41	601328	交通银行	191,400	1,230,702.00	0.49
42	000651	格力电器	32,100	1,203,750.00	0.48
43	688072	拓荆科技	1,350	1,187,365.50	0.47
44	600522	中天科技	19,500	1,183,260.00	0.47
45	603019	中科曙光	10,400	1,115,192.00	0.44
46	603993	洛阳钼业	62,600	1,098,630.00	0.43
47	600150	中国船舶	32,337	1,092,667.23	0.43
48	600887	伊利股份	45,300	1,085,388.00	0.43
49	688521	芯原股份	2,870	1,065,171.80	0.42
50	300604	长川科技	3,100	1,058,402.00	0.42
51	600584	长电科技	10,200	1,056,210.00	0.42
52	000338	潍柴动力	38,500	1,049,125.00	0.41
53	000858	五 粮 液	13,900	1,028,600.00	0.41
54	601816	京沪高铁	210,600	954,018.00	0.38
55	688347	华虹宏力	2,782	935,586.60	0.37
56	600309	万华化学	13,400	916,694.00	0.36
57	002415	海康威视	26,300	899,460.00	0.36
58	300124	汇川技术	13,500	895,455.00	0.35
59	002008	大族激光	5,900	885,649.00	0.35
60	002281	光迅科技	3,400	873,596.00	0.34
61	002916	深南电路	1,900	870,010.00	0.34
62	688120	华海清科	2,700	869,886.00	0.34
63	600111	北方稀土	18,100	869,705.00	0.34
64	000100	TCL 科技	147,900	860,778.00	0.34
65	000063	中兴通讯	23,100	835,989.00	0.33
66	300136	信维通信	6,900	822,825.00	0.32
67	600000	浦发银行	95,500	822,255.00	0.32
68	300857	协创数据	2,400	815,760.00	0.32
69	600089	特变电工	36,200	814,500.00	0.32
70	601857	中国石油	92,900	806,372.00	0.32
71	601088	中国神华	19,700	769,088.00	0.30
72	300433	蓝思科技	14,200	761,972.00	0.30
73	002028	思源电气	4,400	761,200.00	0.30

74	600031	XD 三一重	42,500	734,400.00	0.29
75	300014	亿纬锂能	10,900	708,827.00	0.28
76	002050	三花智控	16,000	701,280.00	0.28
77	000001	平安银行	69,600	699,480.00	0.28
78	601601	XD 中国太	24,500	698,740.00	0.28
79	300475	香农芯创	2,300	690,000.00	0.27
80	000792	盐湖股份	22,700	685,313.00	0.27
81	002714	牧原股份	19,500	682,305.00	0.27
82	600549	厦门钨业	7,900	673,080.00	0.27
83	300223	北京君正	2,700	672,030.00	0.27
84	002353	杰瑞股份	4,400	671,000.00	0.26
85	002156	通富微电	8,700	660,069.00	0.26
86	600406	国电南瑞	28,800	658,080.00	0.26
87	601668	中国建筑	148,200	643,188.00	0.25
88	000657	中钨高新	6,500	622,180.00	0.25
89	002436	兴森科技	12,100	616,495.00	0.24
90	601919	中远海控	45,000	596,700.00	0.24
91	002602	世纪华通	42,300	596,430.00	0.24
92	601988	中国银行	102,700	587,444.00	0.23
93	300760	迈瑞医疗	4,300	584,069.00	0.23
94	601728	中国电信	111,400	578,166.00	0.23
95	600660	福耀玻璃	11,400	575,016.00	0.23
96	300054	鼎龙股份	5,400	572,238.00	0.23
97	601012	隆基绿能	43,500	570,720.00	0.23
98	603501	豪威集团	6,000	569,100.00	0.22
99	601225	陕西煤业	27,800	565,730.00	0.22
100	002230	科大讯飞	13,700	559,508.00	0.22
101	600941	中国移动	6,400	551,232.00	0.22
102	600690	海尔智家	26,900	549,029.00	0.22
103	002352	顺丰控股	17,200	537,672.00	0.21
104	601985	XD 中国核	59,000	532,770.00	0.21
105	002460	赣锋锂业	8,100	529,740.00	0.21
106	688777	中控技术	4,501	528,867.50	0.21
107	002709	天赐材料	10,200	524,586.00	0.21
108	603799	华友钴业	10,800	521,208.00	0.21
109	002938	鹏鼎控股	4,900	516,362.00	0.20
110	000977	浪潮信息	7,300	511,000.00	0.20
111	600160	巨化股份	9,600	508,896.00	0.20
112	300033	同花顺	2,100	506,100.00	0.20
113	300757	罗博特科	800	495,200.00	0.20
114	002851	麦格米特	2,900	484,822.00	0.19
115	300442	润泽科技	5,800	481,806.00	0.19
116	000425	徐工机械	58,800	475,692.00	0.19

117	688126	沪硅产业	11,857	472,975.73	0.19
118	002202	金风科技	19,600	468,440.00	0.18
119	000938	紫光股份	16,200	467,532.00	0.18
120	601600	中国铝业	56,800	466,896.00	0.18
121	600028	中国石化	104,500	466,070.00	0.18
122	600938	中国海油	17,100	464,265.00	0.18
123	300346	南大光电	4,920	455,838.00	0.18
124	002600	领益智造	26,200	454,308.00	0.18
125	002466	天齐锂业	7,400	453,768.00	0.18
126	600460	士兰微	8,300	453,678.00	0.18
127	601766	中国中车	87,200	453,440.00	0.18
128	600050	中国联通	112,100	448,400.00	0.18
129	300567	精测电子	1,400	444,640.00	0.18
130	300661	圣邦股份	3,060	439,048.80	0.17
131	002837	英维克	5,440	432,806.40	0.17
132	002080	中材科技	4,800	432,000.00	0.17
133	002049	紫光国微	4,800	426,000.00	0.17
134	002185	华天科技	19,000	423,890.00	0.17
135	002407	多氟多	8,400	421,932.00	0.17
136	601628	中国人寿	11,900	420,665.00	0.17
137	002179	中航光电	9,100	420,420.00	0.17
138	002138	顺络电子	5,700	416,670.00	0.16
139	601100	恒立液压	3,800	408,728.00	0.16
140	601872	招商轮船	23,100	405,867.00	0.16
141	000568	泸州老窖	5,200	403,104.00	0.16
142	688002	睿创微纳	2,604	402,812.76	0.16
143	600879	航天电子	18,900	402,381.00	0.16
144	300395	菲利华	3,000	401,190.00	0.16
145	002241	歌尔股份	17,800	401,034.00	0.16
146	603288	海天味业	11,900	394,604.00	0.16
147	601006	大秦铁路	85,500	394,155.00	0.16
148	601658	邮储银行	79,100	389,963.00	0.15
149	000408	藏格矿业	5,600	388,192.00	0.15
150	300390	天华新能	4,100	383,391.00	0.15
151	688469	芯联集成	36,089	382,904.29	0.15
152	605117	德业股份	3,604	382,672.72	0.15
153	600905	三峡能源	102,500	380,275.00	0.15
154	601888	中国中免	7,000	375,970.00	0.15
155	600489	中金黄金	20,800	375,440.00	0.15
156	002625	光启技术	12,300	372,936.00	0.15
157	688396	华润微	3,778	368,543.90	0.15
158	000630	铜陵有色	57,700	366,972.00	0.14
159	600893	航发动力	9,500	364,230.00	0.14

160	600010	包钢股份	162,200	361,706.00	0.14
161	600673	东阳光	10,700	359,306.00	0.14
162	688271	联影医疗	3,548	359,164.04	0.14
163	601127	赛力斯	5,800	355,250.00	0.14
164	300058	蓝色光标	25,680	353,356.80	0.14
165	002027	分众传媒	72,500	350,900.00	0.14
166	601689	拓普集团	6,200	349,804.00	0.14
167	002273	水晶光电	9,800	347,704.00	0.14
168	600118	中国卫星	4,200	344,610.00	0.14
169	688111	金山办公	1,615	344,075.75	0.14
170	300037	新宙邦	3,700	343,545.00	0.14
171	600019	宝钢股份	62,500	339,375.00	0.13
172	300751	迈为股份	1,200	338,952.00	0.13
173	600760	中航沈飞	8,100	332,910.00	0.13
174	000426	兴业银锡	10,100	332,896.00	0.13
175	000807	云铝股份	14,900	329,886.00	0.13
176	601168	西部矿业	11,900	322,966.00	0.13
177	600104	上汽集团	32,900	321,104.00	0.13
178	600362	XD 江西铜	7,400	320,420.00	0.13
179	600989	宝丰能源	15,700	319,181.00	0.13
180	300450	先导智能	7,800	317,616.00	0.13
181	601727	上海电气	45,200	316,400.00	0.12
182	600875	东方电气	10,900	313,593.00	0.12
183	600988	赤峰黄金	11,900	313,208.00	0.12
184	002001	新 和 成	11,000	312,620.00	0.12
185	600667	太极实业	10,500	306,390.00	0.12
186	601390	中国中铁	73,400	306,078.00	0.12
187	605589	圣泉集团	4,800	305,136.00	0.12
188	600885	宏发股份	8,840	304,891.60	0.12
189	002422	科伦药业	7,900	304,308.00	0.12
190	688017	绿的谐波	726	303,366.36	0.12
191	000538	云南白药	6,400	303,168.00	0.12
192	002738	中矿资源	5,100	300,849.00	0.12
193	000960	锡业股份	7,000	298,830.00	0.12
194	002126	银轮股份	6,000	298,800.00	0.12
195	600795	国电电力	63,900	298,413.00	0.12
196	600547	山东黄金	12,900	297,861.00	0.12
197	600392	XD 盛和资	10,000	297,700.00	0.12
198	688099	晶晨股份	2,888	297,175.20	0.12
199	000831	中国稀土	5,300	294,097.00	0.12
200	600418	江淮汽车	11,300	291,879.00	0.12
201	600585	海螺水泥	17,200	291,540.00	0.12
202	601669	中国电建	61,800	290,460.00	0.11

203	002648	卫星化学	12,000	281,880.00	0.11
204	600141	兴发集团	6,000	281,820.00	0.11
205	002812	恩捷股份	4,200	281,022.00	0.11
206	002129	TCL 中环	23,200	278,864.00	0.11
207	300316	晶盛机电	4,600	277,840.00	0.11
208	600096	云天化	9,100	276,640.00	0.11
209	300015	爱尔眼科	33,400	275,884.00	0.11
210	301358	湖南裕能	3,600	273,132.00	0.11
211	601179	中国西电	18,300	273,036.00	0.11
212	601868	中国能建	100,300	267,801.00	0.11
213	600346	恒力石化	15,100	267,421.00	0.11
214	600482	中国动力	8,100	265,680.00	0.10
215	002195	岩山科技	40,600	265,524.00	0.10
216	300782	卓胜微	2,400	262,992.00	0.10
217	000066	中国长城	13,800	262,890.00	0.10
218	600497	驰宏锌锗	21,700	262,787.00	0.10
219	002558	巨人网络	9,500	261,820.00	0.10
220	300418	昆仑万维	6,400	258,304.00	0.10
221	600580	卧龙电驱	7,800	258,180.00	0.10
222	000625	长安汽车	35,600	255,252.00	0.10
223	600066	宇通客车	9,500	254,695.00	0.10
224	600426	华鲁恒升	10,600	253,552.00	0.10
225	600157	永泰能源	156,500	251,965.00	0.10
226	600221	海航控股	184,400	248,940.00	0.10
227	002532	天山铝业	23,200	248,936.00	0.10
228	000157	中联重科	35,600	248,132.00	0.10
229	600895	张江高科	6,600	245,850.00	0.10
230	600711	盛屯矿业	22,100	242,437.00	0.10
231	002340	格林美	36,600	241,926.00	0.10
232	688036	传音控股	4,072	240,044.40	0.09
233	600011	华能国际	31,500	239,085.00	0.09
234	600048	保利发展	51,500	238,445.00	0.09
235	300803	指南针	2,600	238,342.00	0.09
236	000933	神火股份	11,200	237,440.00	0.09
237	605499	东鹏饮料	1,920	236,985.60	0.09
238	600143	金发科技	15,300	236,385.00	0.09
239	600438	通威股份	19,300	233,723.00	0.09
240	300017	网宿科技	17,900	232,879.00	0.09
241	600115	中国东航	61,000	232,410.00	0.09
242	002493	荣盛石化	21,500	231,125.00	0.09
243	002236	大华股份	14,000	230,860.00	0.09
244	002131	利欧股份	48,500	230,375.00	0.09
245	600436	片仔癀	2,100	229,488.00	0.09

246	600886	国投电力	17,200	228,932.00	0.09
247	600570	恒生电子	10,800	228,852.00	0.09
248	002456	欧菲光	24,000	227,040.00	0.09
249	002821	凯莱英	1,400	226,800.00	0.09
250	600352	浙江龙盛	18,600	225,246.00	0.09
251	601233	桐昆股份	10,200	220,830.00	0.09
252	003816	中国广核	56,400	220,524.00	0.09
253	603659	璞泰来	7,600	219,868.00	0.09
254	300339	润和软件	5,700	219,507.00	0.09
255	601360	三六零	25,100	218,119.00	0.09
256	601058	赛轮轮胎	18,800	216,764.00	0.09
257	000301	东方盛虹	18,900	216,405.00	0.09
258	300759	康龙化成	7,400	214,082.00	0.08
259	600026	XD 中远海	11,900	213,486.00	0.08
260	002074	国轩高科	7,700	211,827.00	0.08
261	688578	艾力斯	1,937	211,520.40	0.08
262	002555	三七互娱	11,100	209,457.00	0.08
263	688047	龙芯中科	1,350	208,804.50	0.08
264	300438	鹏辉能源	2,500	207,125.00	0.08
265	600009	上海机场	8,900	205,590.00	0.08
266	600196	复星医药	9,100	204,477.00	0.08
267	688213	思特威	1,895	202,897.65	0.08
268	000768	中航西飞	9,900	202,752.00	0.08
269	000975	山金国际	11,900	202,300.00	0.08
270	601111	中国国航	33,400	202,070.00	0.08
271	300207	欣旺达	10,600	201,294.00	0.08
272	300001	特锐德	5,300	200,499.00	0.08
273	600029	南方航空	38,600	199,948.00	0.08
274	002472	双环传动	4,800	199,248.00	0.08
275	600415	小商品城	19,600	199,136.00	0.08
276	002517	恺英网络	12,200	198,250.00	0.08
277	600219	南山铝业	49,400	197,106.00	0.08
278	600674	川投能源	13,900	196,963.00	0.08
279	601186	中国铁建	33,000	196,350.00	0.08
280	002601	龙佰集团	11,900	196,112.00	0.08
281	688122	西部超导	3,122	196,092.82	0.08
282	002128	电投能源	8,400	194,208.00	0.08
283	300458	全志科技	4,900	193,354.00	0.08
284	601877	正泰电器	7,700	193,039.00	0.08
285	601117	中国化学	26,200	192,570.00	0.08
286	600233	圆通速递	12,200	192,150.00	0.08
287	002595	豪迈科技	4,115	191,759.00	0.08
288	300115	长盈精密	6,800	189,992.00	0.08

289	600372	中航机载	17,300	187,705.00	0.07
290	301236	软通动力	4,400	186,780.00	0.07
291	002155	湖南黄金	7,750	184,992.50	0.07
292	600839	四川长虹	26,400	184,272.00	0.07
293	002465	海格通信	14,200	181,334.00	0.07
294	300568	星源材质	9,600	179,712.00	0.07
295	603129	春风动力	700	179,060.00	0.07
296	300347	泰格医药	3,700	177,600.00	0.07
297	600741	华域汽车	11,300	175,376.00	0.07
298	000963	华东医药	6,200	174,344.00	0.07
299	000547	航天发展	9,100	174,265.00	0.07
300	300454	深信服	1,800	173,160.00	0.07
301	688235	百济神州	676	172,116.36	0.07
302	300024	机器人	8,900	172,037.00	0.07
303	002920	德赛西威	2,100	171,150.00	0.07
304	002130	沃尔核材	9,000	170,640.00	0.07
305	002497	雅化集团	8,200	167,034.00	0.07
306	688506	百利天恒	568	167,009.04	0.07
307	603650	彤程新材	1,700	166,566.00	0.07
308	300012	华测检测	12,000	166,320.00	0.07
309	001979	招商蛇口	25,800	165,894.00	0.07
310	000878	云南铜业	10,400	165,152.00	0.07
311	002271	东方雨虹	13,700	162,619.00	0.06
312	002432	九安医疗	2,300	162,564.00	0.06
313	300083	创世纪	11,900	162,078.00	0.06
314	002414	高德红外	12,200	161,772.00	0.06
315	300496	中科创达	2,600	160,654.00	0.06
316	000034	神州数码	5,780	160,395.00	0.06
317	601021	春秋航空	3,500	159,530.00	0.06
318	688676	金盘科技	1,882	159,292.48	0.06
319	002444	巨星科技	5,100	158,610.00	0.06
320	688331	荣昌生物	1,214	158,135.64	0.06
321	300474	景嘉微	2,600	157,248.00	0.06
322	300866	安克创新	1,500	156,750.00	0.06
323	601319	中国人保	22,900	154,804.00	0.06
324	300763	锦浪科技	1,700	153,595.00	0.06
325	603979	金诚信	2,600	153,478.00	0.06
326	000661	长春高新	2,300	153,180.00	0.06
327	000733	振华科技	2,700	152,928.00	0.06
327	002756	永兴材料	2,700	152,928.00	0.06
328	600699	均胜电子	7,000	151,270.00	0.06
329	300748	金力永磁	4,900	151,165.00	0.06
330	002078	太阳纸业	12,000	149,880.00	0.06

331	601615	明阳智能	12,900	149,253.00	0.06
332	300073	当升科技	3,100	148,924.00	0.06
333	300142	沃森生物	11,400	148,086.00	0.06
334	601677	明泰铝业	8,900	147,740.00	0.06
335	603606	东方电缆	3,540	146,945.40	0.06
336	300432	富临精工	7,300	146,657.00	0.06
337	600039	四川路桥	18,700	146,234.00	0.06
338	601800	中国交建	25,500	145,605.00	0.06
339	000423	东阿阿胶	3,200	145,152.00	0.06
340	002025	航天电器	1,900	144,818.00	0.06
341	000002	万　　科A	48,800	144,448.00	0.06
342	300919	中伟新材	3,300	144,375.00	0.06
343	002252	上海莱士	33,100	143,654.00	0.06
344	600226	亨通股份	14,900	142,891.00	0.06
345	688599	天合光能	10,085	142,400.20	0.06
346	603087	甘李药业	2,500	141,900.00	0.06
347	688223	晶科能源	29,475	140,006.25	0.06
348	688169	石头科技	1,470	139,605.90	0.06
349	688266	泽璟制药	1,166	136,025.56	0.05
350	600588	用友网络	14,700	134,946.00	0.05
351	002064	华峰化学	14,200	134,758.00	0.05
352	601633	长城汽车	8,900	134,301.00	0.05
353	300724	捷佳伟创	1,900	134,140.00	0.05
354	001965	招商公路	14,600	133,736.00	0.05
355	000786	北新建材	7,300	132,057.00	0.05
356	688180	君实生物	3,815	129,023.30	0.05
357	002831	裕同科技	3,600	128,016.00	0.05
358	300677	英科医疗	3,200	125,344.00	0.05
359	601618	中国中冶	51,200	124,928.00	0.05
360	600516	方大炭素	20,200	124,634.00	0.05
361	002294	信立泰	3,900	124,371.00	0.05
362	000519	中兵红箭	5,900	124,313.00	0.05
363	603806	福斯特	7,400	124,246.00	0.05
364	600177	雅戈尔	16,500	124,245.00	0.05
365	688390	固德威	1,145	124,243.95	0.05
366	601607	XD上海医	8,000	123,200.00	0.05
367	302132	中航成飞	2,100	122,472.00	0.05
368	002176	江特电机	12,200	122,122.00	0.05
369	300972	万辰集团	700	121,387.00	0.05
370	603260	合盛硅业	2,500	120,650.00	0.05
371	000623	吉林敖东	6,800	120,564.00	0.05
372	688608	恒玄科技	714	119,373.66	0.05
373	000617	中油资本	18,100	119,279.00	0.05

374	688065	凯赛生物	2,491	119,194.35	0.05
375	300832	新产业	2,800	117,600.00	0.05
376	002085	万丰奥威	10,600	117,554.00	0.05
377	300699	光威复材	4,100	117,465.00	0.05
378	300558	贝达药业	1,800	117,126.00	0.05
379	002318	久立特材	4,900	117,110.00	0.05
380	300251	光线传媒	10,500	116,445.00	0.05
381	688188	柏楚电子	1,089	116,196.30	0.05
382	002459	晶澳科技	14,200	115,020.00	0.05
383	002065	东华软件	16,100	114,954.00	0.05
384	002266	浙富控股	22,400	113,344.00	0.04
385	600085	同仁堂	4,900	113,239.00	0.04
386	600499	科达制造	8,200	113,160.00	0.04
387	300342	天银机电	2,400	112,800.00	0.04
388	002044	美年健康	22,400	112,672.00	0.04
389	600515	海南机场	40,900	112,066.00	0.04
390	300409	道氏技术	5,600	111,608.00	0.04
391	605090	九丰能源	3,000	111,510.00	0.04
392	688472	阿特斯	10,293	111,370.26	0.04
393	000400	许继电气	5,100	110,670.00	0.04
394	603596	伯特利	4,444	110,388.96	0.04
395	002223	鱼跃医疗	4,300	110,338.00	0.04
396	002405	四维图新	17,000	109,990.00	0.04
397	688005	容百科技	3,589	109,823.40	0.04
398	301550	斯菱智驱	1,200	109,716.00	0.04
399	300003	乐普医疗	9,200	109,020.00	0.04
400	000415	渤海租赁	26,600	108,262.00	0.04
401	600521	华海药业	7,500	108,000.00	0.04
402	601216	君正集团	24,200	107,932.00	0.04
403	000032	深桑达 A	4,300	107,285.00	0.04
404	000683	博源化工	18,600	107,136.00	0.04
405	000039	中集集团	13,200	107,052.00	0.04
406	600862	中航高科	5,900	106,377.00	0.04
407	000999	华润三九	4,700	105,703.00	0.04
408	603766	隆鑫通用	8,800	104,984.00	0.04
409	600704	物产中大	22,200	104,784.00	0.04
410	600803	新奥股份	6,600	104,280.00	0.04
411	600312	平高电气	5,800	102,428.00	0.04
412	600018	上港集团	21,700	102,424.00	0.04
413	603605	珀莱雅	1,700	101,864.00	0.04
414	000967	盈峰环境	9,600	101,088.00	0.04
415	600332	白云山	5,000	100,200.00	0.04
416	000887	中鼎股份	5,600	100,184.00	0.04

417	600765	中航重机	7,700	99,484.00	0.04
418	300122	智飞生物	8,500	99,365.00	0.04
419	600166	福田汽车	34,000	98,940.00	0.04
420	600153	建发股份	12,400	98,332.00	0.04
421	000830	鲁西化工	8,100	97,200.00	0.04
422	002410	广联达	11,800	96,288.00	0.04
423	600323	XD瀚蓝环	3,500	96,110.00	0.04
424	688116	天奈科技	2,500	95,500.00	0.04
425	002007	华兰生物	7,800	95,082.00	0.04
426	688617	惠泰医疗	509	92,414.04	0.04
427	601799	星宇股份	1,000	90,620.00	0.04
428	603568	伟明环保	5,880	90,434.40	0.04
429	600398	海澜之家	17,200	89,956.00	0.04
430	002603	以岭药业	5,900	88,500.00	0.03
431	688009	中国通号	18,557	88,331.32	0.03
432	601000	唐山港	21,200	87,980.00	0.03
433	601018	宁波港	27,900	87,885.00	0.03
434	300896	爱美客	1,000	87,200.00	0.03
435	002389	航天彩虹	4,900	87,073.00	0.03
436	600529	山东药玻	4,700	86,715.00	0.03
437	600208	衢州发展	30,500	86,315.00	0.03
438	600486	扬农化工	1,700	86,190.00	0.03
439	000738	航发控制	4,700	85,963.00	0.03
440	600008	首创环保	31,600	85,952.00	0.03
441	000932	华菱钢铁	24,500	85,015.00	0.03
442	600170	上海建工	38,200	84,804.00	0.03
443	600998	九州通	18,000	84,420.00	0.03
444	600316	洪都航空	3,000	83,820.00	0.03
445	688114	华大智造	1,606	82,034.48	0.03
446	600820	隧道股份	15,700	81,797.00	0.03
447	603486	科沃斯	1,600	81,200.00	0.03
448	600161	天坛生物	7,000	81,060.00	0.03
449	300118	东方日升	6,500	80,925.00	0.03
450	601238	广汽集团	15,800	80,264.00	0.03
451	603885	吉祥航空	7,800	80,262.00	0.03
452	002607	中公教育	44,200	79,560.00	0.03
453	603816	顾家家居	3,500	78,260.00	0.03
454	603939	益丰药房	4,300	77,314.00	0.03
455	688303	大全能源	4,418	77,005.74	0.03
456	601567	三星电气	5,000	74,700.00	0.03
457	600763	通策医疗	2,200	74,536.00	0.03
458	300676	华大基因	2,100	73,626.00	0.03
459	688166	博瑞医药	2,095	73,345.95	0.03

460	600038	中直股份	2,900	73,341.00	0.03
461	601880	辽港股份	52,800	72,864.00	0.03
462	603392	万泰生物	2,700	72,819.00	0.03
463	300573	兴齐眼药	1,782	72,634.32	0.03
464	600511	国药股份	2,700	70,308.00	0.03
465	600535	天士力	5,300	70,119.00	0.03
466	300049	福瑞医科	1,800	69,984.00	0.03
467	600816	建元信托	28,200	68,808.00	0.03
468	002244	滨江集团	8,900	67,640.00	0.03
469	300100	双林股份	2,400	66,672.00	0.03
470	002120	韵达股份	10,400	66,144.00	0.03
471	601155	新城控股	6,400	65,664.00	0.03
472	000833	粤桂股份	2,800	65,576.00	0.03
473	300144	宋城演艺	11,200	65,072.00	0.03
474	688063	派能科技	1,198	63,817.46	0.03
475	000998	隆平高科	8,400	63,336.00	0.03
476	002544	普天科技	3,400	61,948.00	0.02
477	601866	中远海发	27,900	61,659.00	0.02
478	600064	XD 南京高	8,600	61,318.00	0.02
479	600635	大众公用	13,800	59,064.00	0.02
480	600754	锦江酒店	3,200	57,568.00	0.02
481	000035	中国天楹	11,900	57,477.00	0.02
482	600655	豫园股份	13,900	57,129.00	0.02
483	300457	赢合科技	2,700	56,916.00	0.02
484	300601	康泰生物	4,800	54,432.00	0.02
485	603899	晨光股份	2,600	53,638.00	0.02
486	600004	白云机场	7,300	52,998.00	0.02
487	600663	陆家嘴	8,400	52,752.00	0.02
488	600258	首旅酒店	4,800	52,416.00	0.02
489	600859	王府井	5,600	51,408.00	0.02
490	002091	江苏国泰	7,000	50,610.00	0.02
491	300070	碧水源	15,600	49,764.00	0.02
492	000069	华侨城 A	28,800	47,232.00	0.02
493	600864	哈投股份	8,900	46,191.00	0.02
494	301078	孩子王	6,300	42,588.00	0.02
495	002292	奥飞娱乐	6,300	41,328.00	0.02
496	603833	欧派家居	1,300	39,143.00	0.02
497	600325	华发股份	15,700	36,267.00	0.01
498	002891	中宠股份	1,300	34,736.00	0.01
499	002572	索菲亚	4,100	29,930.00	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	股票名称	数量	公允价值（元）	占基金资产净值比例

	码		（股）		（%）
1	688808	联讯仪器	47	74,463.51	0.03
2	688797	臻宝科技	83	38,899.61	0.02
3	688820	盛合晶微	274	38,768.26	0.02
4	688635	长进光子	94	28,969.86	0.01
5	688785	恒运昌	44	20,378.60	0.01
6	688811	有研复材	652	15,732.76	0.01
7	301531	春光集团	260	13,405.60	0.01
8	301669	高特电子	448	12,723.20	0.01
9	603459	红板科技	143	12,057.76	0.00
10	301696	三瑞智能	135	11,718.00	0.00
11	301687	新广益	111	8,633.58	0.00
12	301680	固德电材	64	7,178.24	0.00
13	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
14	301683	慧谷新材	50	6,088.50	0.00
15	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
16	688816	易思维	69	3,939.90	0.00
17	601112	振石股份	175	3,078.25	0.00
18	603293	埃泰克	42	1,425.06	0.00
19	001220	世盟股份	46	1,277.88	0.00
20	001312	福恩股份	74	1,241.72	0.00
21	603284	林平发展	35	1,220.45	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	300750	宁德时代	2,806,303.00	1.65
2	300308	中际旭创	2,331,556.00	1.37
3	600519	贵州茅台	1,932,704.00	1.14
4	601318	中国平安	1,890,697.00	1.11
5	601899	紫金矿业	1,683,073.00	0.99
6	600036	招商银行	1,403,548.00	0.83
7	300502	新易盛	1,336,219.00	0.79
8	000333	美的集团	1,131,076.00	0.67
9	000858	五 粮 液	1,008,303.00	0.59
10	688498	源杰科技	990,175.46	0.58
11	600900	XD 长江电	967,387.00	0.57
12	601166	兴业银行	933,204.00	0.55
13	301308	江波龙	933,128.00	0.55
14	002475	立讯精密	869,652.00	0.51
15	300394	天孚通信	843,263.00	0.50
16	688525	佰维存储	808,938.20	0.48

17	300059	东方财富	798,599.00	0.47
18	600030	中信证券	788,238.00	0.46
19	688981	中芯国际	715,798.33	0.42
20	601398	工商银行	706,255.00	0.42

注：“本期累计买入金额”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	300750	宁德时代	1,279,963.00	0.75
2	300308	中际旭创	968,983.00	0.57
3	000858	五 粮 液	832,254.00	0.49
4	601318	中国平安	804,817.00	0.47
5	601899	紫金矿业	711,661.00	0.42
6	600519	贵州茅台	679,443.00	0.40
7	300394	天孚通信	669,728.00	0.39
8	600036	招商银行	623,999.00	0.37
9	300502	新易盛	587,953.00	0.35
10	000333	美的集团	535,637.00	0.32
11	688808	联讯仪器	471,464.37	0.28
12	601088	中国神华	461,684.00	0.27
13	688635	长进光子	459,281.00	0.27
14	600900	XD 长江电	432,071.00	0.25
15	601166	兴业银行	415,595.00	0.24
16	002475	立讯精密	411,841.00	0.24
17	300285	国瓷材料	372,536.00	0.22
18	600498	烽火通信	366,498.00	0.22
19	600030	中信证券	339,181.00	0.20
20	300059	东方财富	332,801.00	0.20

注：“本期累计卖出金额”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	91,697,663.81
卖出股票收入（成交）总额	40,542,233.38

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	24,000.64	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	24,000.64	0.01

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	111025	圣泉转债	140	14,000.18	0.01
2	113704	春风转债	100	10,000.46	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体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、处罚的情形披露如下：

2025 年 09 月 12 日,国家金融监督管理总局公示行政处罚决定书,给予招商银行股份有限公司 60 万元人民币的行政处罚。

基金遵循指数化投资理念，绝大部分资产采用完全复制法跟踪指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。本基金对上述主体发行证券的投资遵守本基金管理人基金投资管理相关制度及被动式指数化投资策略。

除上述主体外，本基金投资的前十名证券的其他发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	22,079.07
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,169,570.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,191,649.07

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末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

无。

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	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688808	联讯仪器	74,463.51	0.03	限售股
2	688797	C 臻宝	38,899.61	0.02	限售股
3	688820	盛合晶微	38,768.26	0.02	限售股
4	688635	长进光子	28,969.86	0.01	限售股
5	688785	恒运昌	20,378.60	0.01	限售股

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
交银中证 A500 指数 A	2,021	58,662.15	25,063,915.11	21.14	93,492,285.67	78.86
交银中证 A500 指数 C	1,318	47,334.45	0.00	0.00	62,386,803.51	100.00
合计	3,339	54,190.78	25,063,915.11	13.85	155,879,089.18	86.15

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	交银中证 A500 指数 A	30,373.84	0.03
	交银中证 A500 指数 C	30,007.17	0.05
	合计	60,381.01	0.03

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

无。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	交银中证 A500 指数 A	交银中证 A500 指数 C
基金合同生效日（2025 年 1 月 22 日）基金份额总额	403,628,571.14	236,741,224.11
本报告期期初基金份额总额	98,482,406.62	39,194,418.57
本报告期基金总申购份额	66,949,984.75	74,862,928.91
减：本报告期基金总赎回份额	46,876,190.59	51,670,543.97
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	118,556,200.78	62,386,803.51

注：1、如果本报告期间发生转换入、份额类别调整、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出、份额类别调整业务，则总赎回份额中包含该业务。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动：本报告期内，张宏良先生不再担任公司董事长（法定代表人），由公司总经理袁庆伟女士代为履行公司董事长（法定代表人）职责。

2、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内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

本报告期内未发生涉及本基金管理人、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

无。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，经履行适当程序，本基金聘请容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，未发生基金管理人受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，未发生基金管理人相关从业人员受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，未发生基金托管人受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，未发生基金托管人相关从业人员受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
中信证券	3	131,626,498.07	100.00	24,469.71	100.00	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	3	-	-	-	-	-
国泰海通证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
摩根大通证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-

10.7.2 基金租用或者通过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(%)
中信证券	2,139,984.73	100.00	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
摩根大通证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-

注：1、租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等四个方面；

2、租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准进行综合评价，然后根据评价选择基金交易单元。研究部提交方案，并上报公司批准。

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	交银施罗德中证 A500 指数型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒体及公司网站	2026 年 1 月 21 日

2	交银施罗德中证 A500 指数型证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会规定媒体及公司网站	2026 年 3 月 28 日
3	交银施罗德基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年）	中国证监会规定媒体及公司网站	2026 年 3 月 28 日
4	交银施罗德中证 A500 指数型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒体及公司网站	2026 年 4 月 21 日
5	交银施罗德基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2026 年 6 月 6 日
6	交银施罗德基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2026 年 6 月 13 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

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会准予交银施罗德中证 A500 指数型证券投资基金募集注册的文件；

2、《交银施罗德中证 A500 指数型证券投资基金基金合同》；

3、《交银施罗德中证 A500 指数型证券投资基金招募说明书》；

4、《交银施罗德中证 A500 指数型证券投资基金托管协议》；

5、关于申请募集注册交银施罗德中证 A500 指数型证券投资基金法律意见书；

6、基金管理人业务资格批件、营业执照；

7、基金托管人业务资格批件、营业执照；

8、报告期内交银施罗德中证 A500 指数型证券投资基金在规定报刊上各项公告的原稿。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，或者登录基金管理人的网站(www.fund001.com)查阅。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或

复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人交银施罗德基金管理有限公司。本公司客户服务中心电话：400-700-5000（免长途话费），021-61055000，电子邮件：services@jysld.com。