

# 融通中证 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：融通基金管理有限公司

基金托管人：上海银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人上海银行股份有限公司根据融通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)基金合同规定，于 2025 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 1 月 9 日(基金合同生效日)起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
3.3 其他指标	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
<b>§ 5 托管人报告</b>	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	11
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	14
<b>§ 7 投资组合报告</b>	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
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	55
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	55

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 .....	55
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 .....	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	55
7.12 投资组合报告附注 .....	56
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>57</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	57
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	57
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	57
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 .....	57
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>57</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>58</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	58
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 .....	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	58
10.4 基金投资策略的改变 .....	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	58
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 .....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	58
10.8 其他重大事件 .....	59
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>60</b>
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 .....	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	60
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>60</b>
12.1 备查文件目录 .....	60
12.2 存放地点 .....	61
12.3 查阅方式 .....	61

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	融通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	融通中证 A500ETF
场内简称	A500ETF 融通
基金主代码	159379
交易代码	159379
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 1 月 9 日
基金管理人	融通基金管理有限公司
基金托管人	上海银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	359,821,471.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2025 年 1 月 23 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金，主要采用完全复制法，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。本基金投资策略主要包含股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、存托凭证投资策略、股指期货交易策略、国债期货交易策略、股票期权投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略等部分。
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，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制策略，紧密跟踪中证 A500 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

### 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		融通基金管理有限公司	上海银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	涂卫东	周直毅
	联系电话	(0755) 26948666	(021) 68475608
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	custody@bosc.cn
客户服务电话		400-883-8088、(0755) 26948088	95594
传真		(0755) 26935005	(021) 68476901
注册地址		深圳市南山区粤海街道海珠社区海德三道 1066 号深创投广场 41 层、42 层	上海市黄浦区中山南路 688 号
办公地址		深圳市南山区粤海街道海珠社区海德三道 1066 号深创投广场 41 层、42 层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 号 37 层
邮政编码		518054	200120
法定代表人		张威	顾建忠

## 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	<a href="http://www.rtfund.com">http://www.rtfund.com</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人处、基金托管人处、深圳证券交易所

## 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 9 日(基金合同生效日) - 2025 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	22,763,465.28
本期利润	35,823,564.03
加权平均基金份额本期利润	0.0620
本期加权平均净值利润率	6.11%
本期基金份额净值增长率	4.50%
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	16,185,631.06
期末可供分配基金份额利润	0.0450
期末基金资产净值	376,007,102.06
期末基金份额净值	1.0450
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	4.50%

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

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

3、期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润÷期末基金份额总额。其中期末可供分配利润：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分扣除未实现部分)。

4、本基金的基金合同于 2025 年 1 月 9 日生效，本报告的统计期间为 2025 年 1 月 9 日至本报告期末。

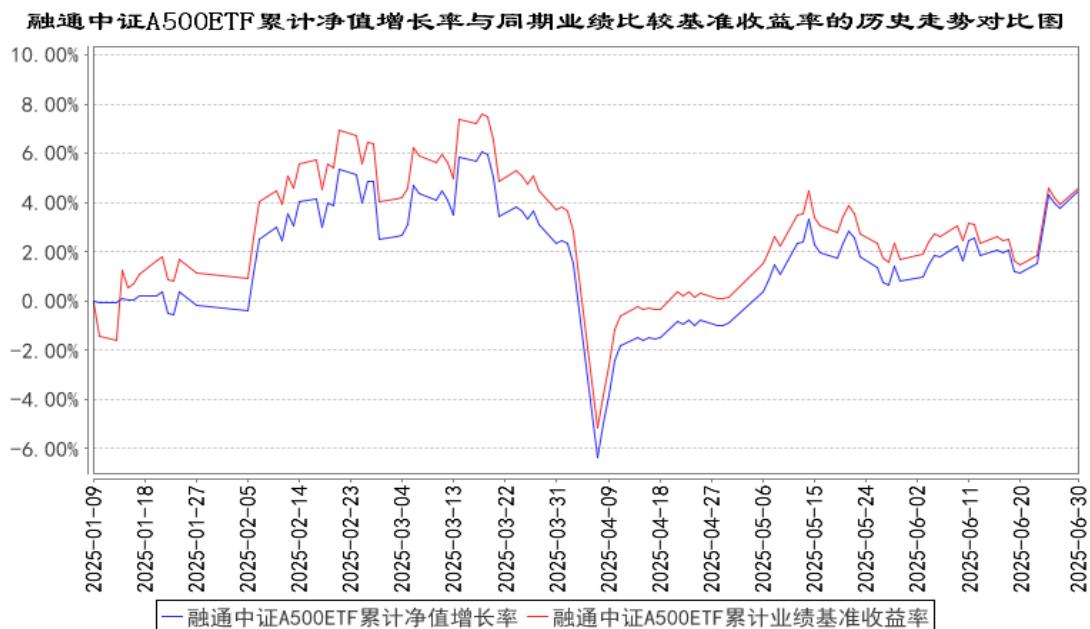
### 3.2 基金净值表现

#### 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	3.67%	0.59%	2.82%	0.60%	0.85%	-0.01%
过去三个月	2.12%	1.19%	0.84%	1.20%	1.28%	-0.01%
自基金合同生效起至今	4.50%	1.02%	4.57%	1.08%	-0.07%	-0.06%

### 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：1、本基金基金合同生效日为 2025 年 1 月 9 日，至报告期末合同生效未满 1 年。

2、本基金的建仓期为自合同生效日起 6 个月，截至报告期末，本基金尚在建仓期内。

### 3.3 其他指标

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

融通基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经中国证监会证监基字[2001]8号文批准，于2001年5月22日成立，公司注册资本12500万元人民币。本公司的股东及其出资比例为：诚通证券股份有限公司60%、日兴资产管理有限公司（Nikko Asset ManagementCo., Ltd.）40%。本基金管理人拥有公募基金管理资格、特定客户（专户）资产管理资格、合格境内机构投资者资格（QDII）、保险资产受托管理资格、人民币合格境内机构投资者（RQDII）资格、合格境内投资企业（QDIE）资格，产品线完备，涵盖主动权益类基金、被动投资类基金、债券基金、货币基金、混合基金、QDII基金等。

#### 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		
熊俊杰	本基金的基金经理	2025 年 1 月 9 日	-	7 年	熊俊杰先生，理学硕士，7 年证券基金行业从业经历，具有基金从业资格。2017 年 10 月至 2018 年 11 月在招商期货有限公司资产管理部工作，2018 年 12 月至 2023 年 7 月在新华基金管理股份有限公司先后担任研究员、投资经理、基金经理助理，2023 年 7 月加入融通基金管理有限公司。现任融通巨潮 100 指数证券投资基金(LOF)基金经理、融通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、融通中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理、融通深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

注：任免日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写；证券从业年限以从事证券、基金业务相关工作的时间为计算标准。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规和本基金合同的规定，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，为基金持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为，本基金投资组合符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

#### 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

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合的原则，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。

本基金管理人对报告期内不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内、10 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行了分析，各投资组合的同向交易价差均处于合理范围之内。

报告期内，本基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发生异常交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在严格遵守基金合同的前提下实现持有人利益的最大化是本基金管理的核心思想，并将此原则贯彻于基金的运作之中。本基金运用量化投资策略进行指数增强和风险管理，在控制基金相对中证 A500 指数增强基金基准的跟踪误差下，力求最终为投资者带来超越基金基准的收益。

回顾 2025 年上半年，中证 A500 上涨 0.47%，沪深 300 上涨 0.03%，中证 500 上涨 3.31%，中证 1000 上涨 6.69%，创业板指上涨 0.52%，总体依旧呈现小盘股占优的行情，市场日均成交额约 1.4 万亿，相较 2024 年下半年有所放量，交投情绪依旧火热。在指数增强方面，本基金总体依旧采取多因子多策略的量化选股增强模型进行投资配置，构建不同风格属性和相关性较低的 Alpha 子策略来搭建多策略模型框架，模型框架运行平稳，2025 年上半年 Alpha 模型中加入了一些新的偏高频的选股因子，进一步增强模型的 Alpha 获取能力，从风格暴露来看，在风格约束的前提下，近期模型总体权重变化不大，相对而言，在价值和量价两大类因子上的权重有所提升。风险管理方面，本基金依旧采取多维度多层次的更精细化的风险约束，风险约束下沉至行业，也会进行风格分域的风险约束，使得风险约束更合理更有效，因子择时模型 2025 年上半年并未触发因子择时信号，此外，2025 年上半年在现有的框架上再加入组合整体层面的 Barra 风险因子约束，使得模型的风险约束的维度更多元。截止到 2025 年二季度末，模型总体依旧呈现均衡偏价值的风格。未来，本基金还是会基于量化模型得到最终持仓，Alpha 模型和风险管理模型也会结合具体情况持续优化升级。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0450 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.50%，业绩比较基准收益率为 4.57%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾 2025 年上半年，我国经济总体较为平稳，GDP 增速上半年取得 5.3% 的好成绩，以旧换新政策带动消费持续结构性改善，服务消费也出现快速增长态势，高端制造业维持高增长势头，出口展现韧性，出口结构持续优化，但总体消费依旧偏弱，地产持续成为拖累项的问题依旧存在。4 月初突发的关税事件可能是 2025 年上半年的一个标志性事件，在此之前，市场经过一波拉升后量能逐渐衰减，市场情绪开始走弱，随着关税事件突发，市场经过一天大跌后持续走强，虽然在 6 月下旬似乎遇到了一定的上涨阻力，但最终逐渐突破市场预期的多个阻力位，持续超市场预期，量能也因此得到了明显提升，两融余额持续走高，市场情绪持续改善，短期形成一定的趋势行情。总体而言，此轮上涨主要还是由于流动性宽松带动市场风险偏好明显回暖，增量资金持续增配权

益市场驱动，红利低波、微盘股、创新药、新消费和光模块等主题均存在结构性行情，2025 年上半年总体也表现较强。

展望 2025 年下半年，适度宽松的货币政策和积极有为的财政政策有望持续发力，经济有望底部持续改善，我国经济有望逐渐走向“强现实”。在经过 2025 年上半年的上涨后，A 股总体估值水平长期看依旧处在合理偏低水平，在市场总体风险偏好提升后，未来 A 股市场有望获益于经济层面的持续改善，配置价值依旧较高。

从风格配置来看，第一，2025 年上半年小盘占优，展望 2025 年下半年，随着经济基本面逐渐改善，市场主要的驱动逻辑可能由流动性驱动转向基本面驱动，再加上小盘风格持续演绎后当下的拥挤度已经有明显提高，后续存在调整风险，2025 年下半年或将有小盘占优逐渐转向与经济相关度更高的大中盘占优；第二，2025 年一季度价值占优，二季度成长占优，总体价值成长表现较为均衡，展望 2025 年下半年，随着市场风险偏好提升，成长有望逐渐占优。总体而言，大小盘风格维度，大盘或将逐渐占优；成长价值风格维度，成长或将逐渐占优。

本基金跟踪的中证 A500 指数聚焦大盘核心龙头板块，成长价值较为均衡。中短期而言，从风格演绎角度看，2025 年下半年依旧具备较高的配置价值；长期而言，随着政策持续发力，经济逐渐改善，中证 A500 板块与经济基本面相关度较高，长期配置价值高，或将持续受益于长线价值型资金的配置需求。

#### 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，本基金的估值业务严格按照《融通基金管理有限公司基金估值业务原则和程序管理细则》进行，公司设立由研究相关部门、风险管理部、登记清算部、稽核审计部和法律合规部共同组成的估值委员会，通过参考行业协会估值意见、参考独立第三方估值服务机构的估值数据等一种或多种方式的有效结合，减少或避免估值偏差的发生。

估值委员会定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及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下及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值政策和程序的修订须经公司总经理办公会议审批后方可实施。基金在采用新投资策略或投资新品种时，应评价现有估值政策和程序的适用性。

截至本报告期末，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订服务协议，由其提供相关债券品种和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，符合法律法规和基金合同的规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金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的情形。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同以及托管协议的有关约定，诚实、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金的利润分配情况符合有关法律法规和基金合同的相关约定。

#### 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

本托管人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，认为复核内容真实、准确、完整，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：融通中证 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
<b>资产：</b>		
货币资金	6.4.7.1	3,827,847.80
结算备付金		—
存出保证金		—
交易性金融资产	6.4.7.2	372,274,583.42
其中：股票投资		372,266,482.93
基金投资		—
债券投资		8,100.49
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		-
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6. 4. 7. 8	77, 527. 80
资产总计		376, 179, 959. 02
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025 年 6 月 30 日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6. 4. 7. 3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		55, 085. 44
应付托管费		18, 361. 82
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	99, 409. 70
负债合计		172, 856. 96
<b>净资产：</b>		
实收基金	6. 4. 7. 10	359, 821, 471. 00
其他综合收益	6. 4. 7. 11	-
未分配利润	6. 4. 7. 12	16, 185, 631. 06
净资产合计		376, 007, 102. 06
负债和净资产总计		376, 179, 959. 02

注:1、报告截止日 2025 年 6 月 30 日,基金份额总额 359, 821, 471. 00 份,基金份额净值 1. 0450 元。

2、本基金合同生效日为 2025 年 1 月 9 日, 2025 年中期报告实际报告期间为 2025 年 1 月 9 日至 2025 年 6 月 30 日。截止报告期末本基金合同生效未满一年, 本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

**6.2 利润表**

会计主体：融通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 9 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 9 日（基金合同生 效日）至 2025 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		36,539,992.74
1. 利息收入		110,224.05
其中：存款利息收入	6.4.7.13	110,224.05
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）		24,561,855.86
其中：股票投资收益	6.4.7.14	19,053,598.46
基金投资收益		—
债券投资收益	6.4.7.15	4,600.54
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	5,503,656.86
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	13,060,098.75
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	-1,192,185.92
<b>减：二、营业总支出</b>		716,428.71
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	415,803.32
其中：暂估管理人报酬		—
2. 托管费	6.4.10.2.2	138,601.10
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	162,024.29
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		35,823,564.03
<b>减：所得税费用</b>		—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		35,823,564.03
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		—

六、综合收益总额		35,823,564.03
----------	--	---------------

### 6.3 净资产变动表

会计主体：融通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 9 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	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	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,067,821,471.00	-	-	1,067,821,471.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-708,000,000.00	-	16,185,631.06	-691,814,368.94
（一）、综合收益总额	-	-	35,823,564.03	35,823,564.03
（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)	-708,000,000.00	-	-19,637,932.97	-727,637,932.97
其中：1. 基金申购款	111,000,000.00	-	-3,368,744.97	107,631,255.03
2. 基金赎回款	-819,000,000.00	-	-16,269,188.00	-835,269,188.00
（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	359,821,471.00	-	16,185,631.06	376,007,102.06

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：

商小虎

王智鲲

刘美丽

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

融通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2024]1754 号《关于准予融通中证 A500 交易型开放

式指数证券投资基金注册的批复》准予注册，由融通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《融通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集，募集期为 2024 年 12 月 23 日至 2025 年 1 月 3 日。本基金为交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,049,547,000.00 元，股票认购人民币 18,221,712.00 元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2025）验字第 70072774\_H01 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《融通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2025 年 1 月 9 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,067,821,471.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 52,759.00 份基金份额。本基金的基金管理人为融通基金管理有限公司，基金托管人为上海银行股份有限公司。

经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）深证上[2025]43 号文审核同意，本基金 1,067,821,471.00 份基金份额于 2025 年 1 月 23 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股（含存托凭证，下同）和备选成份股（含存托凭证，下同）。为更好地实现基金的投资目标，本基金还可投资于非成份股（包括主板、创业板及其他依法发行上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券及其他中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、同业存单、股指期货、国债期货、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）。本基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。本基金的业绩比较基准为：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 6 月 30 日的财务状况以及自 2025 年 1 月 9 日（基金合同生效日）起至 2025 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系自 2025 年 1 月 9 日（基金合同生效日）起至 2025 年 6 月 30 日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

###### （1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产。

###### （2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

##### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负

债)，按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项, 按国家最新规定估值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利, 且该种法定权利现在是可执行的, 同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时, 金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外, 金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示, 不予相互抵销。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时, 申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/ (损失) 占基金净资产比例计算的金额。

未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时, 申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/ (损失) 占基金净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算, 并于期末全额转入“未分配利润/ (累计亏损) ”。

#### 6.4.4.9 收入/(损失) 的确认和计量

(1) 对于以摊余成本计量的金融资产, 采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入, 计入当期损益。处置时, 其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

(2) 对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债, 相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债务工具投资的, 在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益, 扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益; 除上述之外的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税后的净额计入公允价值变动损益。处置时, 其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益。

本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益: 1) 本基金收取股利的权利已经确立; 2) 与股利相关的经济利益很可能流入本基金; 3) 股利的金额能够可靠计量。

(3) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式为现金分红。本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 6.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 6.4.6 税项

##### (1) 增值税及附加

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，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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、地方政府债券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，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金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，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、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》的规定确定。

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7%、3%和2%的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

##### (2) 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。

### （3）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，（如有）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，（如有）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。

### （4）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。

### （5）境外投资

本基金运作过程中如有涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

#### 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	586,079.33
等于： 本金	585,961.28
加： 应计利息	118.05
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	3,241,768.47
等于： 本金	3,241,667.61
加： 应计利息	100.86
减： 坏账准备	—
合计	3,827,847.80

注：其他存款本期末余额为存放在证券经纪商专用证券账户的证券交易结算资金。

##### 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	359,206,384.18	—	372,266,482.93	13,060,098.75
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	—
债券	交易所市场	8,099.96	0.53	8,100.49
	银行间市场	—	—	—
	合计	8,099.96	0.53	8,100.49
资产支持证券	—	—	—	—
基金	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	359,214,484.14	0.53	372,274,583.42	13,060,098.75

##### 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**

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-

待摊费用	77,527.80
合计	77,527.80

#### 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	89,142.09
其他	10,267.61
合计	99,409.70

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	1,067,821,471.00	1,067,821,471.00
本期申购	111,000,000.00	111,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-819,000,000.00	-819,000,000.00
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	359,821,471.00	359,821,471.00

#### 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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	22,763,465.28	13,060,098.75	35,823,564.03
本期基金份额交易产生的变动数	-6,076,745.75	-13,561,187.22	-19,637,932.97

其中：基金申购款	2,650,861.47	-6,019,606.44	-3,368,744.97
基金赎回款	-8,727,607.22	-7,541,580.78	-16,269,188.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	16,686,719.53	-501,088.47	16,185,631.06

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 9 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	77,974.95
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	32,249.10
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	110,224.05

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

#### 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9日（基金合同生效日）至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	12,329,979.02
股票投资收益——赎回差价收入	6,723,619.44
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	19,053,598.46

##### 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 9 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	541,854,151.87
减：卖出股票成本总额	528,807,015.11
减：交易费用	717,157.74
买卖股票差价收入	12,329,979.02

##### 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9日（基金合同生效日）至2025年6月30日
赎回基金份额对价总额	835,269,188.00
减：现金支付赎回款总额	482,268,298.00

减：赎回股票成本总额	346,277,270.56
减：交易费用	-
赎回差价收入	6,723,619.44

#### 6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.14.5 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 2025年1月9日（基金合同生效日）至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	5.16
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	4,595.38
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	4,600.54

##### 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 2025年1月9日（基金合同生效日）至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	18,800.80
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	14,199.94
减：应计利息总额	4.73
减：交易费用	0.75
买卖债券差价收入	4,595.38

##### 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——买卖资产支持证券投资差价收入

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
	2025 年 1 月 9 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	5,503,656.86
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	5,503,656.86

**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 9 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	13,060,098.75
股票投资	13,060,098.75
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	13,060,098.75

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 9 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	-1,194,391.74
其他	2,205.82
合计	-1,192,185.92

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代成分证券的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代成分证券在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

#### 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
	2025 年 1 月 9 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	22,980.62
信息披露费	57,449.86
证券出借违约金	-
银行费用	10.00
登记结算费	72,472.20
其他	9,111.61
合计	162,024.29

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 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
融通基金管理有限公司（“融通基金”）	基金管理人
上海银行股份有限公司（“上海银行”）	基金托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期关联方交易

##### 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
	2025 年 1 月 9 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	415,803.32
其中：应支付销售机构的客户维护费	130,134.67
应支付基金管理人的净管理费	285,668.65

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% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

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 9 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	138,601.10

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% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

**6.4.10.2.3 销售服务费**

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**

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**

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**

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 2025 年 1 月 9 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
上海银行	586,079.33	77,974.95

注：本基金由基金托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息。

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

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
001335	信凯科技	2025-04-02	1-6 个月(含)	首发流通受限	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-
001382	新亚电缆	2025-03-13	1-6 个月(含)	首发流通受限	7.40	20.21	366	2,708.40	7,396.86	-
001388	信通电子	2025-06-24	1 个月内(含)	首发流通受限	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
001388	信通电子	2025-06-24	1-6 个月(含)	首发流通受限	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
001390	古麒绒材	2025-05-21	1-6 个月(含)	首发流通受限	12.08	18.12	178	2,150.24	3,225.36	-
301173	毓恬冠佳	2025-02-24	1-6 个月(含)	首发流通受限	28.33	44.98	173	4,901.09	7,781.54	-
301275	汉朔科技	2025-03-04	1-6 个月(含)	首发流通受限	27.50	56.19	397	10,917.50	22,307.43	-
301479	弘景光电	2025-03-06	1-6 个月(含)	首发流通受限	41.90	77.87	130	5,447.00	10,123.10	-
301479	弘景光电	2025-05-28	1-6 个月(含)	送股流通受限	-	77.87	52	-	4,049.24	-
301501	恒鑫生活	2025-03-11	1-6 个月(含)	首发流通受限	39.92	45.22	241	9,620.72	10,898.02	-
301501	恒鑫生活	2025-06-06	1-6 个月(含)	送股流通受限	-	45.22	108	-	4,883.76	-
301535	浙江华远	2025-03-18	1-6 个月(含)	首发流通受限	4.92	18.99	734	3,611.28	13,938.66	-
301560	众捷汽车	2025-04-17	1-6 个月(含)	首发流通受限	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-
301590	优优绿能	2025-05-28	1-6 个月(含)	首发流通受限	89.60	139.48	73	6,540.80	10,182.04	-
301595	太力科技	2025-05-12	1-6 个月(含)	首发流通受限	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-

301636	泽润新能	2025-04-30	1-6 个月(含)	首发流通受限	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301658	首航新能	2025-03-26	1-6 个月(含)	首发流通受限	11.80	22.98	437	5,156.60	10,042.26	-
301662	宏工科技	2025-04-10	1-6 个月(含)	首发流通受限	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	-
301665	泰禾股份	2025-04-02	1-6 个月(含)	首发流通受限	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-
301678	新恒汇	2025-06-13	1-6 个月(含)	首发流通受限	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	-
603014	威高血净	2025-05-12	1-6 个月(含)	首发流通受限	26.50	32.68	205	5,432.50	6,699.40	-
603049	中策橡胶	2025-05-27	1-6 个月(含)	首发流通受限	46.50	42.85	232	10,788.00	9,941.20	-
603120	肯特催化	2025-04-09	1-6 个月(含)	首发流通受限	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-
603124	江南新材	2025-03-12	1-6 个月(含)	首发流通受限	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-
603202	天有为	2025-04-16	1-6 个月(含)	首发流通受限	93.50	90.66	70	6,545.00	6,346.20	-
603210	泰鸿万立	2025-04-01	1-6 个月(含)	首发流通受限	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	-
603257	中国瑞林	2025-03-28	1-6 个月(含)	首发流通受限	20.52	37.47	78	1,600.56	2,922.66	-
603271	永杰新材	2025-03-04	1-6 个月(含)	首发流通受限	20.60	35.08	126	2,595.60	4,420.08	-
603382	海阳科技	2025-06-05	1-6 个月(含)	首发流通受限	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-
603409	汇通控股	2025-02-25	1-6 个月(含)	首发流通受限	24.18	33.32	100	2,418.00	3,332.00	-
688757	胜科纳米	2025-03-18	1-6 个月(含)	首发流通受限	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	-
688775	影石创新	2025-06-04	1-6 个月(含)	首发流通受限	47.27	124.16	436	20,609.72	54,133.76	-

## 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
123257	安克转债	2025 年 6 月 16 日	1 个月内(含)	配债流通受限	100.00	100.01	81	8,099.96	8,100.49	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

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**

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**

本基金是被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制策略，紧密跟踪中证 A500 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似，预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的主要风险包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的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，通过管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金在严格控制风险并保持基金资产流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。

本基金的基金管理人奉行内控优先和全员风险管理理念，高度重视风险管理的组织保障和制度保障，建立了完备的风险管理组织及相应的制度和流程，力争在风险最小化的前提下，确保基金份额持有人利益最大化。

本基金管理人在董事会下设立风险控制与审计委员会，履行相应风险管理的监督职责。

在公司管理层下设立风险管理委员会，负责指导、协调和监督各职能部门和个业务单元开展风险管理，识别公司各项业务所涉及的各类重大风险，对重大风险、重大决策和重要业务流程的风险进行评估，制定重大风险的解决方案；根据公司风险管理总体策略和各职能部门与业务单元职责分工，组织实施风险应对方案。

公司所有员工是本岗位风险管理的直接责任人，各业务部门负责人是其部门风险管理的第一责任人，基金经理是相应投资组合风险管理的第一责任人。

风险管理部对公司风险管理承担独立评估、监控、检查和报告职责，负责执行公司的风险管理战略和决策，拟定公司风险管理制度，并协同各业务部门制定风险管理流程、评估指标。

监察稽核相关部门负责监察公司各业务部门在相关法律法规、规章制度和业务流程执行方面的情况，确保既定的风险管理措施得到有效的贯彻执行。

#### 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人或具备第三方存管资格的银行保管，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2025 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、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为 0.0022%。

#### 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。

##### 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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中列示的部分基金资产流通暂时受限制外，其余均能及时变现。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银行存款、结算备付金、存出保证金和债券投资等。

###### 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	3,827,847.80	—	—	—	3,827,847.80
交易性金融资产	—	—	8,100.49	372,266,482.93	372,274,583.42
其他资产	—	—	—	77,527.80	77,527.80
资产总计	3,827,847.80	—	8,100.49	372,344,010.73	376,179,959.02
负债					
应付管理人报酬	—	—	—	55,085.44	55,085.44
应付托管费	—	—	—	18,361.82	18,361.82
其他负债	—	—	—	99,409.70	99,409.70
负债总计	—	—	—	172,856.96	172,856.96
利率敏感度缺口	3,827,847.80	—	8,100.49	372,171,153.77	376,007,102.06

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

于 2025 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.0022%，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

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

#### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

无。

#### 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的股票，所面临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。

本基金采用完全复制标的指数的方法，按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整，通过控制股票投资组合与标的指数的跟踪误差，力求实现对标的指数的有效跟踪。风险管理部负责对基金组合的跟踪误差和风险进行评估，定期提交组合跟踪误差和风险监控报告。在跟踪误差超过一定范围时，通知基金经理和相关部门，及时进行投资组合的调整。投资决策委员会根据市场变化对投资组合计划提出风险防范措施。监察稽核部对投资的决策和执行过程进行日常监督。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。此外，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，包括 VaR (Value at Risk) 指标等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	
	2025 年 6 月 30 日	占基金资产净值比例 (%)
	公允价值	

交易性金融资产—股票投资	372,266,482.93	99.01
交易性金融资产—基金投资	—	—
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	372,266,482.93	99.01

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 A500 指数收益率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（2025 年 6 月 30 日）
1. 中证 A500 指数收益率上升 5%		17,116,443.09
2. 中证 A500 指数收益率下降 5%		-17,116,443.09

#### 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
第一层次	371,974,657.31
第二层次	23,486.03
第三层次	276,440.08
合计	372,274,583.42

###### 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等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属

第二层次或第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末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

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

### § 7 投资组合报告

#### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	372,266,482.93	98.96
	其中：股票	372,266,482.93	98.96
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	8,100.49	0.00
	其中：债券	8,100.49	0.00
	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	3,827,847.80	1.02
8	其他各项资产	77,527.80	0.02
9	合计	376,179,959.02	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，7.2 的合计项不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	2,020,352.00	0.54
B	采矿业	18,753,871.56	4.99
C	制造业	215,879,591.17	57.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,445,584.00	3.04
E	建筑业	7,058,128.00	1.88
F	批发和零售业	2,628,551.00	0.70
G	交通运输、仓储和邮政业	12,937,574.00	3.44
H	住宿和餐饮业	319,491.00	0.08

I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,765,596.74	6.59
J	金融业	60,111,391.00	15.99
K	房地产业	3,885,363.00	1.03
L	租赁和商务服务业	4,127,986.60	1.10
M	科学研究和技术服务业	4,130,655.00	1.10
N	水利、环境和公共设施管理业	812,928.00	0.22
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	243,882.00	0.06
Q	卫生和社会工作	1,412,118.00	0.38
R	文化、体育和娱乐业	1,167,437.00	0.31
S	综合	-	-
	合计	371,700,500.07	98.85

### 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	410,670.90	0.11
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	2,244.00	0.00
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	153,067.96	0.04
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	565,982.86	0.15

### 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	600519	贵州茅台	10,162	14,323,542.24	3.81

2	300750	宁德时代	42,800	10,795,016.00	2.87
3	601318	中国平安	174,200	9,664,616.00	2.57
4	600036	招商银行	200,200	9,199,190.00	2.45
5	601166	兴业银行	268,900	6,276,126.00	1.67
6	600900	长江电力	197,900	5,964,706.00	1.59
7	000333	美的集团	79,600	5,747,120.00	1.53
8	601899	紫金矿业	266,500	5,196,750.00	1.38
9	002594	比亚迪	14,600	4,845,886.00	1.29
10	300059	东方财富	204,500	4,730,085.00	1.26
11	600030	中信证券	157,900	4,361,198.00	1.16
12	601398	工商银行	567,000	4,303,530.00	1.14
13	600276	恒瑞医药	72,200	3,747,180.00	1.00
14	000858	五 粮 液	31,400	3,733,460.00	0.99
15	601328	交通银行	431,700	3,453,600.00	0.92
16	000651	格力电器	72,500	3,256,700.00	0.87
17	601288	农业银行	516,600	3,037,608.00	0.81
18	600887	伊利股份	102,400	2,854,912.00	0.76
19	002475	立讯精密	82,105	2,848,222.45	0.76
20	600919	江苏银行	237,400	2,834,556.00	0.75
21	688981	中芯国际	32,028	2,823,908.76	0.75
22	603259	药明康德	40,400	2,809,820.00	0.75
23	601816	京沪高铁	474,700	2,729,525.00	0.73
24	600000	浦发银行	189,900	2,635,812.00	0.70
25	000725	京东方 A	594,100	2,370,459.00	0.63
26	002371	北方华创	5,200	2,299,492.00	0.61
27	300760	迈瑞医疗	9,800	2,202,550.00	0.59
28	601088	中国神华	53,400	2,164,836.00	0.58
29	688041	海光信息	15,063	2,128,251.27	0.57
30	300308	中际旭创	14,400	2,100,384.00	0.56
31	688256	寒武纪	3,475	2,090,212.50	0.56
32	601601	中国太保	55,400	2,078,054.00	0.55
33	300502	新易盛	16,060	2,039,941.20	0.54
34	300124	汇川技术	30,600	1,975,842.00	0.53
35	601728	中国电信	251,000	1,945,250.00	0.52
36	601668	中国建筑	334,100	1,927,757.00	0.51
37	002352	顺丰控股	38,900	1,896,764.00	0.50
38	000001	平安银行	156,900	1,893,783.00	0.50
39	002714	牧原股份	44,200	1,856,842.00	0.49
40	002230	科大讯飞	37,400	1,790,712.00	0.48
41	601127	赛力斯	13,200	1,773,024.00	0.47
42	603501	豪威集团	13,800	1,761,570.00	0.47
43	600031	三一重工	96,000	1,723,200.00	0.46
44	000063	中兴通讯	52,100	1,692,729.00	0.45

45	603019	中科曙光	23,700	1,668,480.00	0.44
46	002415	海康威视	59,800	1,658,254.00	0.44
47	600309	万华化学	30,500	1,654,930.00	0.44
48	600941	中国移动	14,600	1,643,230.00	0.44
49	300274	阳光电源	23,500	1,592,595.00	0.42
50	601857	中国石油	183,100	1,565,505.00	0.42
51	601919	中远海控	102,000	1,534,080.00	0.41
52	688008	澜起科技	18,510	1,517,820.00	0.40
53	600690	海尔智家	60,700	1,504,146.00	0.40
54	600660	福耀玻璃	25,900	1,476,559.00	0.39
55	601012	隆基绿能	98,100	1,473,462.00	0.39
56	600406	国电南瑞	65,000	1,456,650.00	0.39
57	601766	中国中车	196,600	1,384,064.00	0.37
58	603986	兆易创新	10,700	1,353,871.00	0.36
59	600050	中国联通	253,100	1,351,554.00	0.36
60	000568	泸州老窖	11,900	1,349,460.00	0.36
61	000338	潍柴动力	87,700	1,348,826.00	0.36
62	600028	中国石化	235,900	1,330,476.00	0.35
63	300476	胜宏科技	9,800	1,316,924.00	0.35
64	000100	TCL 科技	303,400	1,313,722.00	0.35
65	601988	中国银行	231,600	1,301,592.00	0.35
66	601006	大秦铁路	195,500	1,290,300.00	0.34
67	688012	中微公司	7,058	1,286,673.40	0.34
68	601985	中国核电	133,100	1,240,492.00	0.33
69	601225	陕西煤业	62,700	1,206,348.00	0.32
70	600104	上汽集团	74,900	1,202,145.00	0.32
71	002027	分众传媒	163,800	1,195,740.00	0.32
72	600150	中国船舶	36,100	1,174,694.00	0.31
73	600418	江淮汽车	28,200	1,130,538.00	0.30
74	601628	中国人寿	26,900	1,108,011.00	0.29
75	605499	东鹏饮料	3,400	1,067,770.00	0.28
76	688111	金山办公	3,800	1,064,190.00	0.28
77	603288	海天味业	27,000	1,050,570.00	0.28
78	600760	中航沈飞	17,900	1,049,298.00	0.28
79	000425	徐工机械	133,000	1,033,410.00	0.27
80	000625	长安汽车	80,300	1,024,628.00	0.27
81	000792	盐湖股份	59,900	1,023,092.00	0.27
82	600111	北方稀土	40,900	1,018,410.00	0.27
83	688271	联影医疗	7,969	1,017,960.06	0.27
84	600938	中国海油	38,700	1,010,457.00	0.27
85	600905	三峡能源	231,500	986,190.00	0.26
86	600436	片仔癀	4,900	980,049.00	0.26
87	002625	光启技术	24,400	975,512.00	0.26

88	601658	邮储银行	178,300	975,301.00	0.26
89	600089	特变电工	81,700	974,681.00	0.26
90	601888	中国中免	15,800	963,326.00	0.26
91	603993	洛阳钼业	113,800	958,196.00	0.25
92	002050	三花智控	36,300	957,594.00	0.25
93	300033	同花顺	3,500	955,535.00	0.25
94	600048	保利发展	116,200	941,220.00	0.25
95	300015	爱尔眼科	75,400	940,992.00	0.25
96	600019	宝钢股份	141,900	935,121.00	0.25
97	600547	山东黄金	29,192	932,100.56	0.25
98	601390	中国中铁	166,100	931,821.00	0.25
99	002463	沪电股份	21,800	928,244.00	0.25
100	002241	歌尔股份	39,500	921,140.00	0.24
101	600415	小商品城	44,400	918,192.00	0.24
102	300014	亿纬锂能	19,900	911,619.00	0.24
103	601600	中国铝业	128,200	902,528.00	0.24
104	601989	中国重工	184,400	855,616.00	0.23
105	000977	浪潮信息	16,600	844,608.00	0.22
106	002384	东山精密	22,100	834,717.00	0.22
107	600585	海螺水泥	38,800	833,036.00	0.22
108	600893	航发动力	21,600	832,464.00	0.22
109	002179	中航光电	20,600	831,416.00	0.22
110	600570	恒生电子	24,500	821,730.00	0.22
111	603799	华友钴业	22,000	814,440.00	0.22
112	000538	云南白药	14,417	804,324.43	0.21
113	600584	长电科技	23,100	778,239.00	0.21
114	000938	紫光股份	32,400	777,276.00	0.21
115	000988	华工科技	16,200	761,562.00	0.20
116	601727	上海电气	102,400	756,736.00	0.20
117	002028	思源电气	10,100	736,391.00	0.20
118	600438	通威股份	43,800	733,650.00	0.20
119	300408	三环集团	21,700	724,780.00	0.19
120	002049	紫光国微	11,000	724,460.00	0.19
121	300433	蓝思科技	32,300	720,290.00	0.19
122	000002	万科 A	110,200	707,484.00	0.19
123	600795	国电电力	144,500	699,380.00	0.19
124	600489	中金黄金	47,100	689,073.00	0.18
125	601669	中国电建	139,400	678,878.00	0.18
126	600988	赤峰黄金	26,900	669,272.00	0.18
127	601689	拓普集团	14,000	661,500.00	0.18
128	600010	包钢股份	366,900	656,751.00	0.17
129	300339	润和软件	12,800	650,624.00	0.17
130	002422	科伦药业	18,100	650,152.00	0.17

131	600009	上海机场	20,100	638,577.00	0.17
132	002456	欧菲光	53,800	637,530.00	0.17
133	600160	巨化股份	21,900	628,092.00	0.17
134	601100	恒立液压	8,700	626,400.00	0.17
135	002460	赣锋锂业	18,300	617,991.00	0.16
136	000768	中航西飞	22,400	612,416.00	0.16
137	300394	天孚通信	7,560	603,590.40	0.16
138	601186	中国铁建	74,400	595,944.00	0.16
139	002252	上海莱士	86,100	591,507.00	0.16
140	600183	生益科技	19,600	590,940.00	0.16
141	688036	传音控股	7,373	587,628.10	0.16
142	600839	四川长虹	59,900	582,228.00	0.15
143	000157	中联重科	80,400	581,292.00	0.15
144	601360	三六零	56,700	578,340.00	0.15
145	600989	宝丰能源	35,600	574,584.00	0.15
146	600886	国投电力	38,900	573,386.00	0.15
147	000963	华东医药	14,200	573,112.00	0.15
148	002074	国轩高科	17,500	568,050.00	0.15
149	601058	赛轮轮胎	42,600	558,912.00	0.15
150	600115	中国东航	138,600	558,558.00	0.15
151	300442	润泽科技	11,100	549,783.00	0.15
152	000408	藏格矿业	12,700	541,909.00	0.14
153	000807	云铝股份	33,600	536,928.00	0.14
154	688169	石头科技	3,423	535,870.65	0.14
155	002466	天齐锂业	16,700	535,068.00	0.14
156	002517	恺英网络	27,700	534,887.00	0.14
157	600066	宇通客车	21,500	534,490.00	0.14
158	002001	新和成	24,852	528,602.04	0.14
159	002340	格林美	83,000	527,050.00	0.14
160	000661	长春高新	5,300	525,654.00	0.14
161	688608	恒玄科技	1,500	521,970.00	0.14
162	600426	华鲁恒升	24,000	520,080.00	0.14
163	600196	复星医药	20,600	516,854.00	0.14
164	002195	岩山科技	91,800	516,834.00	0.14
165	002558	巨人网络	21,900	515,745.00	0.14
166	300661	圣邦股份	7,060	513,756.20	0.14
167	001979	招商蛇口	58,500	513,045.00	0.14
168	600029	南方航空	86,900	512,710.00	0.14
169	601800	中国交建	57,400	510,286.00	0.14
170	600011	华能国际	71,400	509,796.00	0.14
171	000975	山金国际	26,900	509,486.00	0.14
172	600674	川投能源	31,700	508,468.00	0.14
173	002236	大华股份	32,000	508,160.00	0.14

174	301236	软通动力	9,300	508,152.00	0.14
175	688506	百利天恒	1,700	503,404.00	0.13
176	002156	通富微电	19,600	502,152.00	0.13
177	688126	沪硅产业	26,580	497,577.60	0.13
178	600487	亨通光电	31,900	488,070.00	0.13
179	600346	恒力石化	34,200	487,692.00	0.13
180	300251	光线传媒	23,800	482,426.00	0.13
181	300418	昆仑万维	14,200	477,546.00	0.13
182	300207	欣旺达	23,800	477,428.00	0.13
183	601111	中国国航	60,400	476,556.00	0.13
184	600745	闻泰科技	14,100	472,773.00	0.13
185	600372	中航机载	39,000	470,340.00	0.13
186	002648	卫星化学	27,100	469,643.00	0.12
187	600460	士兰微	18,900	469,098.00	0.12
188	601868	中国能建	209,700	467,631.00	0.12
189	003816	中国广核	127,400	463,736.00	0.12
190	000066	中国长城	31,300	463,240.00	0.12
191	002916	深南电路	4,270	460,348.70	0.12
192	688213	思特威	4,500	459,990.00	0.12
193	002920	德赛西威	4,500	459,585.00	0.12
194	688777	中控技术	10,178	457,093.98	0.12
195	601117	中国化学	59,100	453,297.00	0.12
196	600096	云天化	20,600	452,582.00	0.12
197	002273	水晶光电	22,600	451,322.00	0.12
198	601319	中国人保	51,600	449,436.00	0.12
199	601168	西部矿业	27,000	449,010.00	0.12
200	600741	华域汽车	25,400	448,310.00	0.12
201	600879	航天电子	42,800	448,116.00	0.12
202	300347	泰格医药	8,400	447,888.00	0.12
203	688120	华海清科	2,654	447,729.80	0.12
204	002465	海格通信	32,100	447,474.00	0.12
205	600588	用友网络	33,300	445,221.00	0.12
206	600256	广汇能源	73,700	443,674.00	0.12
207	600176	中国巨石	38,700	441,180.00	0.12
208	300450	先导智能	17,700	439,845.00	0.12
209	601021	春秋航空	7,900	439,635.00	0.12
210	002601	龙佰集团	27,100	439,291.00	0.12
211	300782	卓胜微	6,140	438,211.80	0.12
212	000831	中国稀土	12,100	437,052.00	0.12
213	300896	爱美客	2,500	437,025.00	0.12
214	601633	长城汽车	20,300	436,044.00	0.12
215	000786	北新建材	16,300	431,624.00	0.11
216	688235	百济神州	1,845	431,065.80	0.11

217	600219	南山铝业	112,500	430,875.00	0.11
218	002555	三七互娱	24,900	430,521.00	0.11
219	600352	浙江龙盛	42,200	428,752.00	0.11
220	002294	信立泰	9,000	425,970.00	0.11
221	300017	网宿科技	39,600	424,512.00	0.11
222	000933	神火股份	25,500	424,320.00	0.11
223	600885	宏发股份	18,960	422,997.60	0.11
224	600482	中国动力	18,300	422,181.00	0.11
225	302132	中航成飞	4,800	422,112.00	0.11
226	688617	惠泰医疗	1,417	420,849.00	0.11
227	002185	华天科技	41,300	417,130.00	0.11
228	600039	四川路桥	42,100	416,790.00	0.11
229	000630	铜陵有色	124,000	414,160.00	0.11
230	688002	睿创微纳	5,900	411,348.00	0.11
231	002493	荣盛石化	49,100	406,548.00	0.11
232	688396	华润微	8,585	404,868.60	0.11
233	002129	TCL 中环	52,400	402,432.00	0.11
234	600085	同仁堂	11,100	400,266.00	0.11
235	001965	招商公路	33,200	398,400.00	0.11
236	300866	安克创新	3,500	397,600.00	0.11
237	601877	正泰电器	17,400	394,458.00	0.10
238	002709	天赐材料	21,700	393,204.00	0.10
239	600362	江西铜业	16,700	391,281.00	0.10
240	002281	光迅科技	7,900	389,628.00	0.10
241	002130	沃尔核材	16,300	388,266.00	0.10
242	000423	东阿阿胶	7,400	387,020.00	0.10
243	688099	晶晨股份	5,438	386,152.38	0.10
244	300454	深信服	4,100	386,138.00	0.10
245	002595	豪迈科技	6,500	384,930.00	0.10
246	002131	利欧股份	109,600	383,600.00	0.10
247	002085	万丰奥威	24,000	381,360.00	0.10
248	300223	北京君正	5,500	380,600.00	0.10
249	300122	智飞生物	19,400	380,046.00	0.10
250	688122	西部超导	7,313	379,398.44	0.10
251	603392	万泰生物	6,200	378,200.00	0.10
252	002738	中矿资源	11,700	376,272.00	0.10
253	300002	神州泰岳	31,800	375,240.00	0.10
254	002532	天山铝业	45,100	374,781.00	0.10
255	300058	蓝色光标	56,960	373,657.60	0.10
256	300474	景嘉微	5,100	372,300.00	0.10
257	600161	天坛生物	19,300	370,367.00	0.10
258	002472	双环传动	11,000	368,390.00	0.10
259	002138	顺络电子	13,100	368,372.00	0.10

260	603129	春风动力	1,700	368,050.00	0.10
261	002180	纳思达	16,000	367,040.00	0.10
262	002078	太阳纸业	27,100	364,766.00	0.10
263	603596	伯特利	6,900	363,561.00	0.10
264	300832	新产业	6,400	363,008.00	0.10
265	002938	鹏鼎控股	11,300	361,939.00	0.10
266	002436	兴森科技	27,200	360,128.00	0.10
267	600233	圆通速递	27,800	358,342.00	0.10
268	000301	东方盛虹	43,000	358,190.00	0.10
269	002410	广联达	26,700	358,047.00	0.10
270	002128	电投能源	18,100	358,018.00	0.10
271	300346	南大光电	11,200	354,368.00	0.09
272	600862	中航高科	13,500	352,080.00	0.09
273	300759	康龙化成	14,300	350,922.00	0.09
274	600143	金发科技	34,000	350,540.00	0.09
275	600188	兖矿能源	28,800	350,496.00	0.09
276	300024	机器人	20,300	348,754.00	0.09
277	002065	东华软件	36,300	348,480.00	0.09
278	300395	菲利华	6,800	347,480.00	0.09
279	300136	信维通信	15,500	347,200.00	0.09
280	300054	鼎龙股份	12,100	347,028.00	0.09
281	688047	龙芯中科	2,598	346,547.22	0.09
282	002353	杰瑞股份	9,900	346,500.00	0.09
283	603606	东方电缆	6,700	346,457.00	0.09
284	000034	神州数码	9,200	346,288.00	0.09
285	002223	鱼跃医疗	9,700	345,320.00	0.09
286	688072	拓荆科技	2,245	345,078.95	0.09
287	002202	金风科技	33,600	344,400.00	0.09
288	300496	中科创达	6,000	343,320.00	0.09
289	601618	中国中冶	115,000	342,700.00	0.09
290	688578	艾力斯	3,677	342,108.08	0.09
291	000999	华润三九	10,800	337,824.00	0.09
292	601615	明阳智能	29,300	336,657.00	0.09
293	688223	晶科能源	64,360	334,028.40	0.09
294	002624	完美世界	21,900	332,223.00	0.09
295	300383	光环新网	23,200	331,760.00	0.09
296	002271	东方雨虹	30,900	331,557.00	0.09
297	002008	大族激光	13,600	331,432.00	0.09
298	600515	海南机场	92,800	328,512.00	0.09
299	600845	宝信软件	13,900	328,318.00	0.09
300	002405	四维图新	38,400	327,936.00	0.09
301	688266	泽璟制药	3,041	326,937.91	0.09
302	601872	招商轮船	52,000	325,520.00	0.09

303	603659	璞泰来	17,300	324,894.00	0.09
304	600895	张江高科	12,600	323,820.00	0.09
305	300604	长川科技	7,200	323,352.00	0.09
306	603087	甘李药业	5,900	323,202.00	0.09
307	603605	珀莱雅	3,900	322,881.00	0.09
308	600549	厦门钨业	15,400	322,168.00	0.09
309	002459	晶澳科技	32,200	321,356.00	0.09
310	000733	振华科技	6,400	320,320.00	0.09
311	300459	汤姆猫	57,200	320,320.00	0.09
312	000426	兴业银锡	20,200	319,160.00	0.08
313	300012	华测检测	27,200	317,968.00	0.08
314	002155	湖南黄金	17,800	317,730.00	0.08
315	300627	华测导航	8,880	310,800.00	0.08
316	688599	天合光能	21,190	307,890.70	0.08
317	605117	德业股份	5,840	307,534.40	0.08
318	605589	圣泉集团	10,900	302,475.00	0.08
319	300253	卫宁健康	28,400	301,040.00	0.08
320	300699	光威复材	9,500	300,865.00	0.08
321	601216	君正集团	54,400	300,288.00	0.08
322	300037	新宙邦	8,500	299,200.00	0.08
323	600332	白云山	11,300	297,868.00	0.08
324	600392	盛和资源	22,600	297,642.00	0.08
325	000617	中油资本	40,700	297,110.00	0.08
326	002444	巨星科技	11,600	295,916.00	0.08
327	688180	君实生物	8,700	295,626.00	0.08
328	000519	中兵红箭	13,500	295,515.00	0.08
329	300003	乐普医疗	21,400	294,892.00	0.08
330	000932	华菱钢铁	66,700	293,480.00	0.08
331	600153	建发股份	28,300	293,471.00	0.08
332	000878	云南铜业	22,800	290,016.00	0.08
333	300073	当升科技	6,600	289,542.00	0.08
334	002389	航天彩虹	11,300	289,280.00	0.08
335	601233	桐昆股份	27,200	288,320.00	0.08
336	300316	晶盛机电	10,600	287,790.00	0.08
337	601799	星宇股份	2,300	287,500.00	0.08
338	300001	特锐德	11,900	285,243.00	0.08
339	300628	亿联网络	8,200	285,032.00	0.08
340	300142	沃森生物	25,800	283,800.00	0.08
341	600803	新奥股份	15,000	283,500.00	0.08
342	603979	金诚信	6,100	283,284.00	0.08
343	002821	凯莱英	3,200	282,400.00	0.08
344	002414	高德红外	27,500	281,875.00	0.07
345	600699	均胜电子	16,000	279,040.00	0.07

346	300568	星源材质	21,900	277,692.00	0.07
347	002007	华兰生物	17,600	275,792.00	0.07
348	002812	恩捷股份	9,400	275,326.00	0.07
349	603260	合盛硅业	5,800	274,920.00	0.07
350	600118	中国卫星	9,600	274,272.00	0.07
351	600521	华海药业	14,700	273,861.00	0.07
352	600177	雅戈尔	37,500	273,750.00	0.07
353	002152	广电运通	20,100	270,144.00	0.07
354	600398	海澜之家	38,600	268,656.00	0.07
355	601238	广汽集团	35,800	268,142.00	0.07
356	300315	掌趣科技	44,000	267,080.00	0.07
357	600704	物产中大	50,600	266,662.00	0.07
358	000738	航发控制	12,800	265,600.00	0.07
359	300413	芒果超媒	12,100	264,022.00	0.07
360	600316	洪都航空	7,000	263,900.00	0.07
361	000623	吉林敖东	15,400	261,030.00	0.07
362	002044	美年健康	50,700	260,598.00	0.07
363	600497	驰宏锌锗	49,200	260,268.00	0.07
364	600038	中直股份	6,700	260,027.00	0.07
365	600765	中航重机	15,400	259,952.00	0.07
366	002318	久立特材	11,100	259,629.00	0.07
367	000009	中国宝安	29,200	259,296.00	0.07
368	600018	上港集团	45,000	256,950.00	0.07
369	600141	兴发集团	12,500	256,625.00	0.07
370	601567	三星医疗	11,400	255,588.00	0.07
371	000400	许继电气	11,600	252,532.00	0.07
372	002409	雅克科技	4,600	251,574.00	0.07
373	300919	中伟股份	7,600	249,888.00	0.07
374	601677	明泰铝业	20,000	248,400.00	0.07
375	688188	柏楚电子	1,868	245,940.88	0.07
376	600637	东方明珠	32,900	245,763.00	0.07
377	300724	捷佳伟创	4,500	244,350.00	0.06
378	002607	中公教育	79,700	243,882.00	0.06
379	000960	锡业股份	15,900	243,270.00	0.06
380	601607	上海医药	13,600	243,168.00	0.06
381	603939	益丰药房	9,900	242,253.00	0.06
382	600498	烽火通信	11,500	241,845.00	0.06
383	600563	法拉电子	2,200	239,998.00	0.06
384	300757	罗博特科	1,600	239,952.00	0.06
385	002245	蔚蓝锂芯	18,700	239,921.00	0.06
386	600529	山东药玻	10,800	239,112.00	0.06
387	300088	长信科技	40,100	238,996.00	0.06
388	300558	贝达药业	4,100	237,595.00	0.06

389	002407	多氟多	19,400	236,486.00	0.06
390	300182	捷成股份	42,900	236,379.00	0.06
391	002841	视源股份	6,800	235,280.00	0.06
392	000039	中集集团	29,800	234,228.00	0.06
393	002739	万达电影	20,400	233,172.00	0.06
394	600026	中远海能	22,500	232,425.00	0.06
395	300068	南都电源	14,500	230,840.00	0.06
396	301358	湖南裕能	7,400	230,806.00	0.06
397	601018	宁波港	62,700	229,482.00	0.06
398	002025	航天电器	4,400	226,204.00	0.06
399	600486	扬农化工	3,900	226,200.00	0.06
400	000887	中鼎股份	12,800	225,152.00	0.06
401	300763	锦浪科技	3,900	223,821.00	0.06
402	300285	国瓷材料	12,900	223,815.00	0.06
403	688303	大全能源	10,439	222,559.48	0.06
404	600820	隧道股份	35,700	217,770.00	0.06
405	603806	福斯特	16,800	217,728.00	0.06
406	300296	利亚德	35,400	215,940.00	0.06
407	600008	首创环保	71,500	215,930.00	0.06
408	300144	宋城演艺	25,200	215,460.00	0.06
409	603486	科沃斯	3,700	215,451.00	0.06
410	688009	中国通号	41,792	214,810.88	0.06
411	002064	华峰化学	32,400	214,164.00	0.06
412	600516	方大炭素	45,800	212,512.00	0.06
413	002497	雅化集团	18,600	212,040.00	0.06
414	002312	川发龙蟒	18,400	211,232.00	0.06
415	600763	通策医疗	5,100	210,528.00	0.06
416	603568	伟明环保	11,000	209,880.00	0.06
417	600998	九州通	40,400	207,656.00	0.06
418	600166	福田汽车	76,400	207,044.00	0.06
419	600170	上海建工	86,600	206,974.00	0.06
420	603816	顾家家居	8,000	204,160.00	0.05
421	300676	华大基因	4,100	204,057.00	0.05
422	600208	衢州发展	68,900	203,944.00	0.05
423	601179	中国西电	33,000	202,620.00	0.05
424	002176	江特电机	27,800	201,828.00	0.05
425	600312	平高电气	13,100	201,609.00	0.05
426	000683	博源化工	42,000	201,180.00	0.05
427	605358	立昂微	8,600	200,380.00	0.05
428	002432	九安医疗	5,500	200,365.00	0.05
429	601155	新城控股	14,500	198,360.00	0.05
430	002244	滨江集团	20,100	195,975.00	0.05
431	601000	唐山港	48,200	195,692.00	0.05

432	603613	国联股份	8,200	194,258.00	0.05
433	300567	精测电子	3,200	193,952.00	0.05
434	000629	钒钛股份	75,600	193,536.00	0.05
435	000818	航锦科技	8,600	193,500.00	0.05
436	000708	中信特钢	16,400	192,864.00	0.05
437	600323	瀚蓝环境	7,900	192,365.00	0.05
438	002603	以岭药业	13,600	191,760.00	0.05
439	603885	吉祥航空	14,100	189,927.00	0.05
440	000830	鲁西化工	18,400	189,520.00	0.05
441	002439	启明星辰	11,800	188,682.00	0.05
442	600535	天士力	12,000	187,800.00	0.05
443	600499	科达制造	18,600	182,280.00	0.05
444	601880	辽港股份	121,200	181,800.00	0.05
445	688005	容百科技	8,128	181,416.96	0.05
446	600511	国药股份	6,200	180,792.00	0.05
447	603000	人民网	8,900	179,869.00	0.05
448	300390	天华新能	9,400	179,258.00	0.05
449	002145	中核钛白	42,800	177,620.00	0.05
450	600655	豫园股份	31,900	177,045.00	0.05
451	600859	王府井	12,700	176,403.00	0.05
452	000563	陕国投 A	49,400	176,358.00	0.05
453	600004	白云机场	19,200	174,720.00	0.05
454	601966	玲珑轮胎	11,900	174,573.00	0.05
455	603899	晨光股份	6,000	173,940.00	0.05
456	600131	国网信通	9,800	173,460.00	0.05
457	603077	和邦生物	99,100	173,425.00	0.05
458	000547	航天发展	20,620	173,208.00	0.05
459	600325	华发股份	35,300	171,911.00	0.05
460	300529	健帆生物	7,900	170,403.00	0.05
461	603833	欧派家居	3,000	169,350.00	0.05
462	600754	锦江酒店	7,500	168,300.00	0.04
463	002756	永兴材料	5,300	168,275.00	0.04
464	300601	康泰生物	10,900	165,571.00	0.04
465	000998	隆平高科	16,600	163,510.00	0.04
466	300751	迈为股份	2,300	159,988.00	0.04
467	300070	碧水源	35,400	159,300.00	0.04
468	601866	中远海发	64,300	158,821.00	0.04
469	002120	韵达股份	23,700	158,790.00	0.04
470	600667	太极实业	24,100	158,578.00	0.04
471	300438	鹏辉能源	5,700	157,377.00	0.04
472	600867	通化东宝	19,000	155,800.00	0.04
473	002544	普天科技	6,600	154,770.00	0.04
474	600258	首旅酒店	10,700	151,191.00	0.04

475	000032	深桑达 A	7,400	149,702.00	0.04
476	000069	华侨城 A	65,700	147,825.00	0.04
477	002508	老板电器	7,700	146,377.00	0.04
478	300457	赢合科技	6,300	144,900.00	0.04
479	000967	盈峰环境	20,600	143,170.00	0.04
480	300573	兴齐眼药	2,760	142,940.40	0.04
481	002831	裕同科技	6,100	142,862.00	0.04
482	300118	东方日升	14,800	141,784.00	0.04
483	002292	奥飞娱乐	14,300	138,996.00	0.04
484	600129	太极集团	6,300	134,253.00	0.04
485	002572	索菲亚	9,300	130,293.00	0.03
486	002266	浙富控股	42,200	129,976.00	0.03
487	601636	旗滨集团	25,800	129,258.00	0.03
488	688063	派能科技	2,750	123,970.00	0.03
489	603650	彤程新材	3,800	122,170.00	0.03
490	000035	中国天楹	28,300	121,407.00	0.03
491	688390	固德威	2,785	121,008.25	0.03
492	600864	哈投股份	20,200	120,594.00	0.03
493	300769	德方纳米	3,600	118,872.00	0.03
494	600315	上海家化	5,500	115,885.00	0.03
495	002091	江苏国泰	15,600	113,412.00	0.03
496	002372	伟星新材	10,400	107,744.00	0.03
497	001914	招商积余	6,900	85,353.00	0.02
498	600007	中国国贸	3,300	67,914.00	0.02
499	600335	国机汽车	9,900	63,855.00	0.02
500	301381	赛维时代	1,900	37,905.00	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	301535	浙江华远	7,336	151,854.44	0.04
2	688757	胜科纳米	5,357	150,145.30	0.04
3	688775	影石创新	436	54,133.76	0.01
4	301275	汉朔科技	397	22,307.43	0.01
5	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
6	301501	恒鑫生活	349	15,781.78	0.00
7	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
8	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
9	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
10	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
11	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
12	603049	中策橡胶	232	9,941.20	0.00
13	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
14	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00

15	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
16	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
17	603202	天有为	70	6,346.20	0.00
18	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
19	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
20	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
21	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
22	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
23	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
24	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
25	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
26	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
27	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
28	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
29	603120	肯特催化	65	2,172.95	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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	56,046,822.26	14.91
2	300750	宁德时代	36,154,351.80	9.62
3	601318	中国平安	29,280,241.59	7.79
4	600036	招商银行	27,136,896.00	7.22
5	600900	长江电力	19,306,679.99	5.13
6	000333	美的集团	18,057,078.50	4.80
7	601166	兴业银行	16,602,025.71	4.42
8	300059	东方财富	14,490,228.16	3.85
9	601899	紫金矿业	14,288,054.00	3.80
10	600030	中信证券	14,091,218.35	3.75
11	000858	五粮液	13,564,891.00	3.61
12	601398	工商银行	12,544,180.00	3.34
13	002594	比亚迪	11,656,618.30	3.10
14	688981	中芯国际	11,433,412.61	3.04
15	600276	恒瑞医药	10,627,140.92	2.83
16	002475	立讯精密	10,233,473.35	2.72
17	000651	格力电器	9,907,458.00	2.63
18	600887	伊利股份	9,867,788.00	2.62
19	601328	交通银行	9,743,964.00	2.59
20	688041	海光信息	9,396,011.27	2.50
21	002371	北方华创	9,047,919.89	2.41
22	601816	京沪高铁	9,035,110.00	2.40
23	601288	农业银行	8,748,690.00	2.33
24	300760	迈瑞医疗	8,067,396.00	2.15

25	000725	京东方 A	7,919,938.00	2.11
26	600309	万华化学	7,655,065.00	2.04
27	600919	江苏银行	7,633,769.00	2.03

注：“买入金额”是指买入股票成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	41,262,967.00	10.97
2	601318	中国平安	21,551,744.47	5.73
3	600036	招商银行	19,799,227.00	5.27
4	600900	长江电力	13,410,984.00	3.57
5	601166	兴业银行	11,721,663.52	3.12
6	601899	紫金矿业	10,400,646.93	2.77
7	600030	中信证券	9,922,950.54	2.64
8	601398	工商银行	9,028,760.00	2.40
9	688981	中芯国际	8,033,170.66	2.14
10	600276	恒瑞医药	7,786,124.33	2.07
11	688041	海光信息	7,559,332.67	2.01
12	600887	伊利股份	6,970,055.00	1.85
13	601328	交通银行	6,571,565.00	1.75
14	601288	农业银行	6,309,796.00	1.68
15	601816	京沪高铁	6,262,016.00	1.67
16	600919	江苏银行	5,488,296.00	1.46
17	600309	万华化学	5,476,856.00	1.46
18	603259	药明康德	5,252,967.00	1.40
19	601088	中国神华	5,190,604.00	1.38
20	601988	中国银行	5,036,713.00	1.34

注：“卖出金额”是指卖出股票成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

#### 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	1,175,519,426.25
卖出股票收入（成交）总额	541,854,151.87

注：表中“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（成交）总额”均指成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

#### 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）	8,100.49	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	8,100.49	0.00

#### 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	123257	安克转债	81	8,100.49	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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地参与股指期货交易。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货交易时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

#### 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

本基金参与国债期货交易是为了有效控制债券市场的系统性风险，本基金将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，适度运用国债期货提高投资组合运作效率。在参与国债期货交易时，基金管理人通过对宏观经济和利率市场走势的分析与判断，并充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置，谨慎进行投资，以调整债券组合的久期，降低投资组合的整体风险。

##### 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

1、本基金投资的前十名证券中的兴业银行，其发行主体为兴业银行股份有限公司。根据发布的相关公告，该证券发行主体因未依法履行职责，受到国家金融监督管理总局福建监管局的处罚。

投资决策说明：本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

### 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

无。

### 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	—
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	77,527.80
8	其他	—
9	合计	77,527.80

### 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

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	688775	影石创新	54,133.76	0.01	首发流通受限
2	301275	汉朔科技	22,307.43	0.01	首发流通受限
3	301678	新恒汇	17,014.28	0.00	首发流通受限
4	301535	浙江华远	13,938.66	0.00	首发流通受限
5	688757	胜科纳米	13,903.84	0.00	首发流通受限

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
407	884,082.24	338,578,570.00	94.10	21,242,901.00	5.90

### 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	中国诚通控股集团有限公司	330,228,171.00	91.78
2	华泰证券股份有限公司	3,000,146.00	0.83
3	方正证券股份有限公司	2,206,728.00	0.61
4	陈俊莲	1,439,000.00	0.40
5	东北证券股份有限公司	1,005,122.00	0.28
6	刘凡	1,000,077.00	0.28
7	蔡桂芳	1,000,048.00	0.28
8	王华华	1,000,048.00	0.28
9	常呈建	1,000,019.00	0.28
10	吕文峰	1,000,019.00	0.28
11	芜湖起重运输机器股份有限公司	1,000,019.00	0.28

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	49,000.00	0.01362

### 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

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2025年1月9日)基金份额总额	1,067,821,471.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	111,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	819,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	359,821,471.00

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，本基金的基金管理人无重大人事变动。

#### 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，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金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

本基金聘请的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

### 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

本报告期内，本基金的基金管理人及其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

本报告期内，本基金的托管人托管业务部门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(%)	
国投证券	4	1,716,001,084.84	100.00	336,210.39	100.00	-

注：1. 本基金使用券商交易模式。

2. 本基金选择的券商为国投证券。本基金管理人与国投证券不存在关联方关系。

3. 券商交易模式下的券商选择标准为：

（1）券商财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易等服务能力较强，同时拥有良

好的公司声誉。

(2) 券商研究实力较强, 有稳定的研究机构和专业的研究人员, 能及时为本公司提供高质量的研究支持与服务, 包括宏观与策略报告、行业与公司分析报告、债券市场分析报告和金融衍生品分析报告等, 并能根据基金投资的特定需求, 提供专门研究报告。

(3) 严禁将券商选择、交易量分配等与基金销售规模、保有规模挂钩, 严禁以任何形式向券商承诺基金证券交易量及佣金或利用交易佣金与券商进行利益交换。

(4) 公司销售业务人员不得参与券商选择、协议签订、服务评价、交易佣金分配等业务环节。

(5) 公司不得使用交易佣金向第三方转移支付费用, 包括但不限于使用外部专家咨询、金融终端、研报平台、数据库等产生的费用。

#### 4. 券商交易模式下的券商选择程序为:

(1) 本基金管理人根据上述标准对券商进行考察评价后, 经公司内部审批程序确定选用的券商;

(2) 本基金管理人和被选中的券商签订经纪服务协议。

#### 5. 交易单元变更情况

本基金使用证券公司结算模式, 本基金选择的证券经纪商是国投证券, 本报告期内无变更。

#### 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(%)
国投证券	41,100.80	100.00	-	-	-	-

#### 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	融通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 1 月 10 日
2	融通基金管理有限公司关于融通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金投资关联方证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 1 月 14 日
3	融通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 1 月 20 日
4	融通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 1 月 20 日
5	融通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 1 月 20 日
6	关于融通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基	中国证监会指	2025 年 1 月 23 日

	金新增流动性服务商的公告	定报刊及网站	
7	关于融通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 1 月 23 日
8	融通基金管理有限公司关于提醒投资者注意防范不法分子诈骗活动的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 2 月 28 日
9	融通基金管理有限公司关于暂停部分销售机构办理相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 3 月 14 日
10	融通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	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 3 月 31 日
11	融通基金管理有限公司关于系统升级期间暂停服务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 4 月 16 日
12	关于融通基金管理有限公司旗下部分基金新增流动性服务商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 5 月 20 日
13	融通基金管理有限公司关于旗下部分深交所 ETF 新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 5 月 20 日
14	融通基金管理有限公司关于提醒投资者警惕虚假网站和 APP 的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 5 月 26 日
15	融通基金管理有限公司关于终止民商基金销售（上海）有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 6 月 5 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	20250109-20250630	-	599,228,171.00	269,000,000.00	330,228,171.00	91.78
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时，可能存在因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金份额净值剧烈波动的风险及流动性风险。							

### 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

- (一) 中国证监会准予融通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金注册的文件
- (二) 《融通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- (三) 《融通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- (四) 《融通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》

(五) 融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照

(六) 报告期内在指定报刊上披露的各项公告

## 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处、深圳证券交易所。

## 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件，或登录本基金管理人网站  
<http://www.rtfund.com> 查阅。

融通基金管理有限公司

2025 年 8 月 28 日