

中银证券中证 A500 指数型证券投资基金 2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：中银国际证券股份有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	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
3.3 其他指标	8
§ 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合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	58
§ 8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
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	60
§ 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	61
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	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	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	65
12.3 查阅方式	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中银证券中证 A500 指数型证券投资基金	
基金简称	中银证券中证 A500 指数	
基金主代码	023153	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 3 月 19 日	
基金管理人	中银国际证券股份有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	88,902,262.33 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中银证券中证 A500 指数 A	中银证券中证 A500 指数 C
下属分级基金的交易代码	023153	023154
报告期末下属分级基金的份额总额	80,549,182.99 份	8,353,079.34 份

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化
投资策略	本基金通过股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略及融资和转融通证券出借业务策略，以期获得长期稳定收益。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中银国际证券股份有限公司	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	盖文国	张立学
	联系电话	021-20328000	010-68858113
	电子邮箱	gmkf@bocichina.com	zhanglixue@psbcoa.com.cn
客户服务电话		021-61195566, 400-620-8888	95580
传真		021-50372474	010-86353609
注册地址		上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39F	北京市西城区金融大街 3 号
办公地址		上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39F	北京市西城区金融大街 3 号 A 座

邮政编码	200120	100808
法定代表人	周冰（代行）	郑国雨

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.bocifunds.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中银国际证券股份有限公司	上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层

§ 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	2025 年 3 月 19 日（基金合同生效日）-2025 年 6 月 30 日	
和指标	中银证券中证 A500 指数 A	中银证券中证 A500 指数 C
本期已实现收益	1,833,630.59	101,755.33
本期利润	4,120,689.37	279,319.66
加权平均基金份 额本期利润	0.0229	0.0109
本期加权平均净 值利润率	2.29%	1.09%
本期基金份额净 值增长率	2.84%	2.77%
3.1.2 期末数据	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
和指标		
期末可供分配利 润	1,560,529.58	156,570.63
期末可供分配基 金份额利润	0.0194	0.0187
期末基金资产净 值	82,833,238.68	8,584,626.73
期末基金份额净 值	1.0284	1.0277

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	2.84%	2.77%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2、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；

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中银证券中证 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
过去一个月	3.29%	0.56%	2.68%	0.57%	0.61%	-0.01%
过去三个月	2.92%	0.46%	0.83%	1.14%	2.09%	-0.68%
自基金合同生效起至今	2.84%	0.43%	-2.67%	1.09%	5.51%	-0.66%

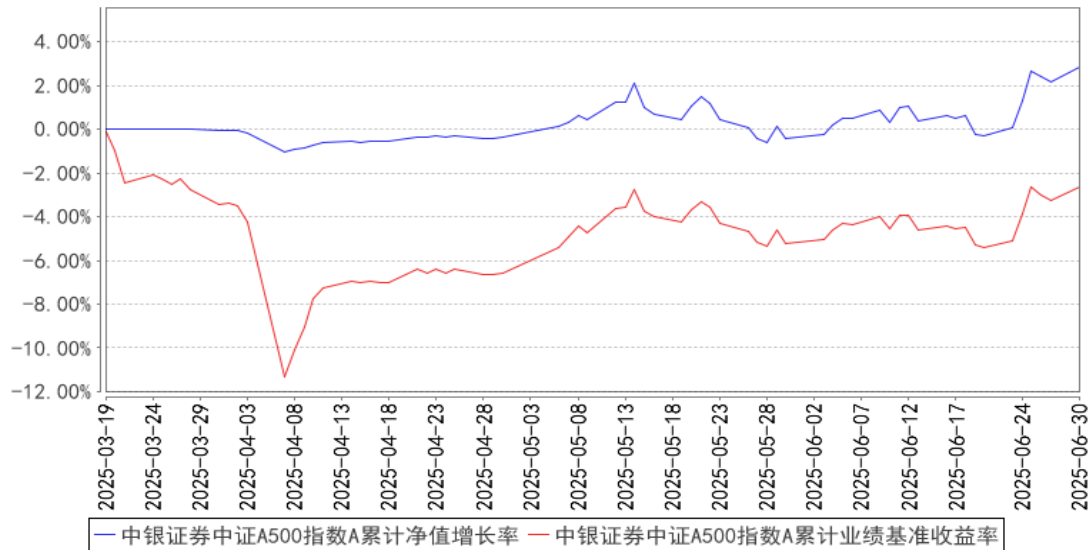
中银证券中证 A500 指数 C

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
过去一个月	3.27%	0.56%	2.68%	0.57%	0.59%	-0.01%
过去三个月	2.85%	0.46%	0.83%	1.14%	2.02%	-0.68%
自基金合同生效起至今	2.77%	0.43%	-2.67%	1.09%	5.44%	-0.66%

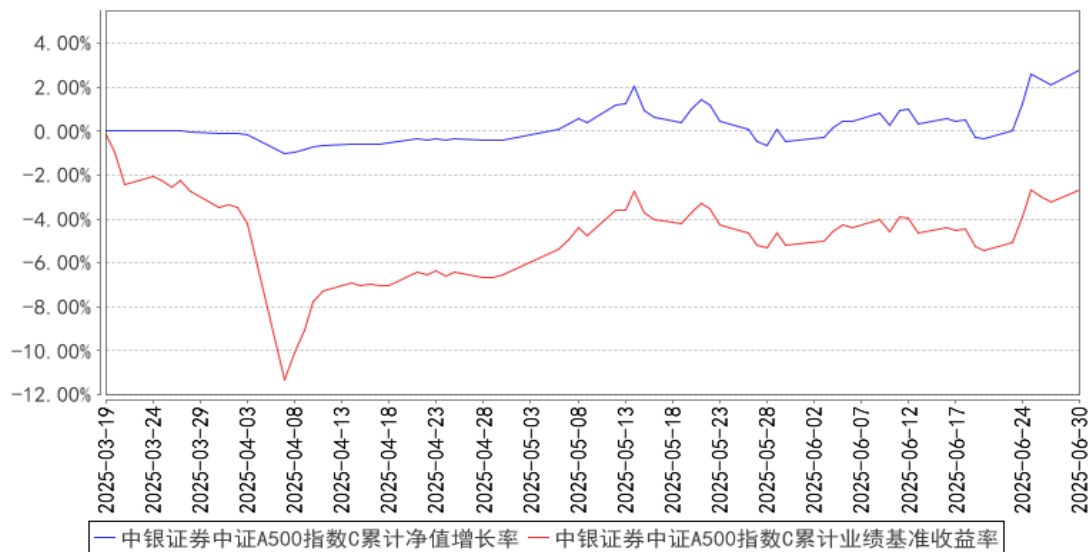
注：业绩比较基准=中证 A500 指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中银证券中证A500指数A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



中银证券中证A500指数C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同于 2025 年 3 月 19 日生效，截至报告期末，本基金成立未满一年。按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期，截至报告期末，本基金尚在建仓期内。

3.3 其他指标

注：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

中银国际证券股份有限公司(以下简称“中银证券”)经中国证监会批准于 2002 年 2 月 28 日在上海成立,注册资本 27.78 亿元人民币。截至 2025 年 6 月 30 日,前十名股东包括中银国际控股有限公司、中国石油集团资本有限责任公司、江西铜业股份有限公司、香港中央结算有限公司、江苏洋河酒厂股份有限公司、中国通用技术(集团)控股有限责任公司、中国建设银行股份有限公司—国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、中国农业银行股份有限公司—中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、朱晔、井冈山郝乾企业管理中心(有限合伙)。中银证券的经营经营范围包括:证券经纪;证券投资咨询;与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问;证券承销与保荐;证券自营;证券资产管理;证券投资基金代销;融资融券;代销金融产品;公开募集证券投资基金管理业务;为期货公司提供中间介绍业务。

截至 2025 年 6 月 30 日,本管理人共管理 45 只证券投资基金,包括:中银国际证券股份有限公司旗下中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金(原中银证券保本 1 号混合型证券投资基金)、中银证券健康产业灵活配置混合型证券投资基金、中银证券现金管家货币市场基金、中银证券安进债券型证券投资基金、中银证券安弘债券型证券投资基金、中银证券汇宇定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券聚瑞混合型证券投资基金、中银证券汇嘉定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券安誉债券型证券投资基金、中银证券汇享定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券新能源灵活配置混合型证券投资基金、中银证券安源债券型证券投资基金、中银证券中高等级债券型证券投资基金、中银证券安泽债券型证券投资基金、中银证券科技创新混合型证券投资基金(LOF)、中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、中银证券安沛债券型证券投资基金、中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中银证券汇远一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券汇兴一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券优选行业龙头混合型证券投资基金、中银证券安汇三年定期开放债券型证券投资基金、中银证券创业板交易型开放式指数证券投资基金、中银证券鑫瑞 6 个月持有期混合型证券投资基金、中银证券精选行业股票型证券投资基金、中银证券汇福一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券盈瑞混合型证券投资基金、中银证券优势制造股票型证券投资基金、中银证券安灝债券型证券投资基金、中银证券安业债券型证券投资基金、中银证券内需增长混合型证券投资基金、中银证券恒瑞 9 个月持有期混合型证券投资基金、中银证券远见价值混合型证券投资基金、中银证券慧泽稳健 3 个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、中银证券慧泽进取 3

个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、中银证券慧泽平衡 3 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、中银证券安添 3 个月定期开放债券型证券投资基金、中银证券汇裕一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券凌瑞 6 个月持有期混合型证券投资基金、中银证券安澈债券型证券投资基金、中银证券中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、中银证券和瑞一年持有期混合型证券投资基金、中银证券鸿安债券型证券投资基金、中银证券鸿瑞债券型证券投资基金、中银证券中证 A500 指数型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
计伟	本基金的基金经理	2025 年 3 月 19 日	—	17 年	计伟，硕士研究生，中国国籍，已取得证券、基金从业资格。2012 年 1 月至 2016 年 8 月任职于华安基金管理有限公司，担任基金经理；2016 年 8 月至 2019 年 7 月任职于汇安基金管理有限公司，担任指数与量化投资副总经理、ETF 投资部总经理、基金经理；2019 年 10 月加入中银国际证券股份有限公司，历任中银证券祥瑞混合型证券投资基金、中银证券瑞益灵活配置混合型证券投资基金、中银证券安弘债券型证券投资基金基金经理，现任基金管理部 ETF 投资团队负责人及中银证券创业板交易型开放式指数证券投资基金、中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、中银证券盈瑞混合型证券投资基金、中银证券中证 A500 指数型证券投资基金基金经理。
张艺敏	本基金的基金经理	2025 年 3 月 19 日	—	7 年	张艺敏，硕士研究生，中国国籍，已取得证券、基金从业资格。2017 年 7 月至 2020 年 5 月任职于汇安基金管理有限公司，历任产品及创新业务部产品经理、ETF 投资部基金经理助理，2020 年 5 月加入中银国际证券股份有限公司，历任中银证券创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，现任中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中银证券创业板交易型开放式指数证券投资基金、中银证券中证 A500 指数型证券投资基金基金经理。

注：1、上述任职日期为根据公司确定的聘任日期，离任日期为根据公司确定的解聘日期；首任基

金经理的任职日期为基金合同生效日。

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

4.1.3 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

注：无

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、基金合同以及其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

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

为了保证公司管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益，本基金管理人根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，建立了《资产管理业务公平交易管理办法》、《资产管理业务异常交易监控与报告管理办法》等公平交易相关制度体系。公司旗下投资组合严格按照制度的规定，参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，主要包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关环节。研究团队负责提供投资研究支持，投资团队负责投资决策，交易室负责实施交易并实时监控，投资监督团队负责事前监督、事中检查和事后稽核，对交易情况进行合理性分析。通过多部门的协作互控，保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

公司一直严格遵循公平交易相关规章制度，执行严格的公平交易行为。在严格方针指导下，报告期内，未出现任何异常关联交易以及与禁止交易对手间的交易行为。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗口下（如：1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合向交易开展交易价差分析。分析结果表明，本报告期内公司对各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发生同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量 5%的情况。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

过去半年权益市场整体呈现震荡态势，期间中证 A500 指数上涨 0.5%，高于沪深 300，低于中证 500、万得全 A。报告期内对指数涨幅正贡献最大的三大成分行业为银行、有色、电子，负贡献最大的三大成分行业为食品饮料、电力设备及新能源、石油石化。截至 6 月底，中证 A500 指数滚动市盈率 15 倍，处于过去五年 66%左右分位。报告期内标的指数完成一次成分股定期调整，调整后行业结构整体稳定。

本基金于 3 月下旬成立，得益于相对谨慎的建仓节奏较好的规避了 4 月初的市场冲击，截至六月底已完成建仓操作。本基金主要采取完全复制法以紧密跟踪标的指数表现，力争基金跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。由于覆盖建仓期，报告期内本基金的跟踪误差较大，预计后续跟踪误差将恢复至常规水平。除建仓因素以外本基金的跟踪误差主要来源于基金份额的申购赎回、标的指数成分股调整等。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中银证券中证 A500 指数 A 基金份额净值为 1.0284 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.84%；同期业绩比较基准收益率为-2.67%。截至本报告期末中银证券中证 A500 指数 C 基金份额净值为 1.0277 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.77%；同期业绩比较基准收益率为-2.67%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年权益市场整体较为震荡，经历了年初 AI 及中国科技资产重估带来的估值溢价提升，也经历了预期太满及局部交易过热带来的股价回撤，以及 4 月初关税冲击引发的系统性下跌和强有力救市政策及冲突边际和缓带来的市场修复。同时我们看到市场成交活跃度仍保持在较高水平，行业主题轮动持续，市场风险偏好提升，多数一级行业及宽基指数年内收益率开始转正，赚钱效应逐渐累积。另一方面，经济基本面的修复局部有亮点但整体尚不稳固，企业盈利的全面好转还需等待。展望后市，我们认为在相对宽松积极的政策环境下，宽基指数向下的概率和幅度相对有限，那么企业盈利改善的到来、增量政策的落地、边际事件催化等因素的出现则有望成为未来市场收益的机会。

中证 A500 指数作为核心宽基指数，网罗大小行业龙头，且其相对分散均衡的行业和个股结构能够较为从容地应对市场主题轮动。本基金作为一只投资于中证 A500 的指数产品，将秉承指数化投资策略，严格遵守基金合同，积极应对基金申购赎回、成分调整等因素对指数跟踪效果带来的冲击，努力降低本基金跟踪误差，为投资者提供一个标准化的中证 A500 投资工具。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了中银国际证券股份有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。由公司领导担任主席，成员由资产管理板块负责人、基金管理部、信评与投资监督部、运营管理总部、内控与法律合规部、风险管理部等部门负责人组成。估值委员会成员均具有专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力，具有绝对的独立性。估值委员会的职责主要包括有：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理人作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述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央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未实施利润分配。

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

本基金报告期内不存在连续二十个工作日基金持有人数低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在中银证券中证 A500 指数型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金

份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 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：中银证券中证 A500 指数型证券投资基金

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
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	13,506,376.46
结算备付金		523,613.39
存出保证金		92,949.09
交易性金融资产	6.4.7.2	85,733,931.02
其中：股票投资		85,733,931.02
基金投资		—
债券投资		—
资产支持证券投资		—
贵金属投资		—
其他投资		—
衍生金融资产	6.4.7.3	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—
债权投资	6.4.7.5	—
其中：债券投资		—
资产支持证券投资		—
其他投资		—
其他债权投资	6.4.7.6	—
其他权益工具投资	6.4.7.7	—
应收清算款		450,141.89
应收股利		—
应收申购款		1,815,578.17
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.8	—
资产总计		102,122,590.02
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 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		1,256.93
应付赎回款		10,630,269.63
应付管理人报酬		13,320.56
应付托管费		4,440.16
应付销售服务费		1,349.57
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	54,087.76
负债合计		10,704,724.61
净资产：		
实收基金	6.4.7.10	88,902,262.33
其他综合收益	6.4.7.11	-
未分配利润	6.4.7.12	2,515,603.08
净资产合计		91,417,865.41
负债和净资产总计		102,122,590.02

注：本基金合同生效日为 2025 年 03 月 19 日，本报告期自基金合同生效日 2025 年 03 月 19 日起至 2025 年 06 月 30 日止。报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 88,902,262.33 份，其中中银证券中证 A500 指数 A 基金份额总额 80,549,182.99 份，基金份额净值 1.0284 元；中银证券中证 A500 指数 C 基金份额总额 8,353,079.34 份，基金份额净值 1.0277 元。

6.2 利润表

会计主体：中银证券中证 A500 指数型证券投资基金

本报告期：2025 年 3 月 19 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 3 月 19 日（基金合同 生效日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		4,579,895.21
1. 利息收入		372,925.26
其中：存款利息收入	6.4.7.13	170,084.57
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		202,840.69
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,733,109.70

其中：股票投资收益	6.4.7.14	603,909.68
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	55,010.93
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	1,074,189.09
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	2,464,623.11
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	9,237.14
减：二、营业总支出		179,886.18
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	87,136.81
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	29,045.56
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	14,460.69
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		730.24
8. 其他费用	6.4.7.23	48,512.88
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,400,009.03
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,400,009.03
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		4,400,009.03

6.3 净资产变动表

会计主体：中银证券中证 A500 指数型证券投资基金

本报告期：2025 年 3 月 19 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			
	2025 年 3 月 19 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	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	299,989,538.73	-	-	299,989,538.73
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-211,087,276.40	-	2,515,603.08	-208,571,673.32
(一)、综合收益总额	-	-	4,400,009.03	4,400,009.03
(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)	-211,087,276.40	-	-1,884,405.95	-212,971,682.35
其中：1. 基金申购款	7,594,627.08	-	68,728.35	7,663,355.43
2. 基金赎回款	-218,681,903.48	-	-1,953,134.30	-220,635,037.78
(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	88,902,262.33	-	2,515,603.08	91,417,865.41

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：

周冰

基金管理人负责人

沈锋

主管会计工作负责人

戴景义

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中银证券中证 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]1808 号《关于准予中银证券中证 A500 指数型证券投资基金注册的批复》准予注册, 由中银国际证券股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银证券中证 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, 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 299,904,188.52 元, 业经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)毕马威华振验字第 2500292 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中银证券中证 A500 指数型证券投资基金基金合同》于 2025 年 3 月 19 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 299,989,538.73 份基金份额, 其中认购资金利息折合 85,350.21 份基金份额。本基金的基金管理人为中银国际证券股份有限公司, 基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司(以下简称“邮储银行”)。

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。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用, 但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额, 称为 A 类基金份额; 在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用, 而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额, 称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同, 本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值, 计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银证券中证 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, 包括标的指数成份股及备选成份股(含存托凭证)、除标的指数成份股及备选成份股以外的其他国内依法发行或上市的股票(包括主板、创业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(包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、中期票据、地方政府债、政府支持债券、政府支持机构债券、次级债、可转换债券(含交易分离可转债)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款等)、货币市场工具、股指期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为: 本基金投资于股票(含存托凭证)资产的比例不低于基金资产的 90%; 投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产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、股票期权合约需缴纳的交易保证金后, 应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%, 其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为: 中证 A500 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款税后利率 $\times$ 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人中银国际证券股份有限公司于 2025 年 8 月 29 日批准报

出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2025 年 06 月 30 日的财务状况、自 2025 年 03 月 19 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 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

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2025 年 03 月 19 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

金融资产的分类取决于本基金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。

本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

– 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金以摊余成本计量的金融资产主要为货币资金、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

– 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债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。本基金以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/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

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。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，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金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；或者(3) 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

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。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；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，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，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，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，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，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，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，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现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损益占基金净资产比例计算的金额。未实现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损益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认列，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

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的

相关税费后的净额，在证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入证券出借业务利息收入。

投资收益

股票投资收益、债券投资收益、资产支持证券投资收益和衍生工具投资收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生工具、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

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

(1) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的该类别基金份额净值自动转为相应类别的基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；(2) 基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去该类别每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；(3) 由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同；本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 外币交易

无。

6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。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）本基金的基金管理人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）本基金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。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《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》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”）在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值或减值。

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

本基金本报告期末未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末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》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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	13,506,376.46
等于：本金	13,504,388.22
加：应计利息	1,988.24
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	13,506,376.46

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		83,269,307.91	-	85,733,931.02	2,464,623.11
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		83,269,307.91	-	85,733,931.02	2,464,623.11

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

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

本基金本报告期内未计提买入返售金融资产减值准备。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内未计提债权投资减值准备。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内未计提其他债权投资减值准备。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

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	5,574.88
其中：交易所市场	5,574.88
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	48,512.88
合计	54,087.76

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

中银证券中证 A500 指数 A

项目	本期 2025 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	254,218,565.24	254,218,565.24
本期申购	4,223,207.11	4,223,207.11
本期赎回（以“-”号填列）	-177,892,589.36	-177,892,589.36
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	80,549,182.99	80,549,182.99

中银证券中证 A500 指数 C

项目	本期 2025 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	45,770,973.49	45,770,973.49
本期申购	3,371,419.97	3,371,419.97
本期赎回（以“-”号填列）	-40,789,314.12	-40,789,314.12
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	8,353,079.34	8,353,079.34

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

中银证券中证 A500 指数 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
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	1,833,630.59	2,287,058.78	4,120,689.37
本期基金份额交易产生的变动数	-273,101.01	-1,563,532.67	-1,836,633.68
其中：基金申购款	33,127.26	-20,508.24	12,619.02
基金赎回款	-306,228.27	-1,543,024.43	-1,849,252.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,560,529.58	723,526.11	2,284,055.69

中银证券中证 A500 指数 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
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	101,755.33	177,564.33	279,319.66
本期基金份额交易产生的变动数	54,815.30	-102,587.57	-47,772.27
其中：基金申购款	45,519.37	10,589.96	56,109.33
基金赎回款	9,295.93	-113,177.53	-103,881.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	156,570.63	74,976.76	231,547.39

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	169,047.00
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	996.16
其他	41.41
合计	170,084.57

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3月19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	603,909.68
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	603,909.68

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3月19日（基金合同生效日）至2025年6月30日
卖出股票成交总额	85,787,124.23
减：卖出股票成本总额	85,074,236.12
减：交易费用	108,978.43
买卖股票差价收入	603,909.68

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益-证券出借差价收入。

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3月19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	48,560.05
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	6,450.88
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	55,010.93

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3月19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	42,599,859.89
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	41,955,400.78
减：应计利息总额	638,008.23

减：交易费用	-
买卖债券差价收入	6,450.88

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益-其他投资收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 3 月 19 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	1,074,189.09
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	1,074,189.09

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 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	2,464,623.11
股票投资	2,464,623.11
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	2,464,623.11

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	9,237.14
合计	9,237.14

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费全额归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中基金的赎回费全额归入转出基金的基金资产。

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2025 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	12,402.00
信息披露费	36,110.88
证券出借违约金	-
合计	48,512.88

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

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

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中银国际证券股份有限公司（“中银证券”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国邮政储蓄银行股份有限公司（“邮储银行”）	基金托管人、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	中银国际控股有限公司（基金管理人股东）的控股股东、基金销售机构
上海国际港务（集团）股份有限公司（“上港集团”）	基金托管人的关联方

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
中银证券	254,130,668.26	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例（%）
中银证券	52,017,252.44	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）
中银证券	433,155,000.00	100.00

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年3月19日（基金合同生效日）至2025年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
中银证券	49,790.43	100.00	5,574.88	100.00

注：1、上述佣金以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示，2024 年 6 月 30 日起证券交易佣金费率水平按照中国证券监督管理委员会于 2024 年 4 月 19 日制定发布的《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》相关要求执行。

2、因基金管理人中银证券属于具有公募管理人资格的综合类券商，根据交易所会员交易席位管理的相关要求，基金管理人旗下公募基金参与证券交易仅能使用基金管理人自有交易席位进行，暂不能使用其他证券公司的交易席位进行证券交易。

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 3 月 19 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	87,136.81
其中：应支付销售机构的客户维护费	37,802.12
应支付基金管理人的净管理费	49,334.69

注：支付基金管理人中银证券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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 3 月 19 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	29,045.56

注：支付基金托管人招商银行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。计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}。$$

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		
	2025 年 3 月 19 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		
	中银证券中证 A500 指数 A	中银证券中证 A500 指数 C	合计
中银证券	—	7,712.99	7,712.99
中国银行	—	3,203.87	3,203.87
邮储银行	—	532.17	532.17
合计	—	11,449.03	11,449.03

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给中银证券，再由中银证券计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：本基金本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

注：本基金本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金管理人于本报告期内未运用固有资金投资本基金。

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

注：于本基金本报告期末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

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 3 月 19 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
邮储银行	13,506,376.46	169,047.00

注：本基金的银行存款由基金托管人邮储银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于本期末，本基金持有关联方中国银行、邮储银行、上港集团发行的普通股，成本总额为人民币 570,903.18 元，估值总额为人民币 585,418.00 元，占本基金基金资产净值的比例为 0.64%

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

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

注：本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金主要投资于股票、债券等具有良好流动性的金融工具。与这些金融工具相关的风险，以及本基金的基金管理人对于相关风险采取的风险管理政策如下所述。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金，紧密跟踪中证 A500 指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪中证 A500 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。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求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%。

本基金的基金管理人在公司风险管理体系的基础上构建明晰基金业务的风险管理组织架构和职能，由董事会及其风险控制委员会、执行委员会、风险管理委员会、风险管理部、基金管理部、中后线部门等相关业务部门构成多层级风险管理框架体系。董事会决定公司风险偏好，并在风险控制委员会的协助下监察公司基金业务的总体风险及管理状况。执行委员会领导公司基金业务的风险管理。风险管理委员会协助执行委员会在董事会授权范围内听取和审议包括公募基金在内的资产管理业务风险相关报告，评估风险管理状况。在业务操作层面，风险管理部、信评与投资监督部负责落实公司基金业务的风险管理制度，协调并与各部门合作履行风险管理职责。业务主管对各自业务的风险管理负有首要责任。财务部、运营管理总部、审计部、内控与法律合规部等中后线部门在各自职能范围内支持或监督公司风险管理。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、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邮储银行，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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

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 2025 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：不适用。

6.4.13.3.2 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期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。

本基金所持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“期末本基金持有的流通受限证券”附注。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%。于 2025 年 6 月 30 日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未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。于 2025 年 6 月 30 日，本基金确认的净赎回申请未超过 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。

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的利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为货币资金、结算备付金和存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	13,506,376.46	-	-	-	13,506,376.46
结算备付金	523,613.39	-	-	-	523,613.39
存出保证金	92,949.09	-	-	-	92,949.09
交易性金融资产	-	-	-	85,733,931.02	85,733,931.02
应收申购款	-	-	-	1,815,578.17	1,815,578.17
应收清算款	-	-	-	450,141.89	450,141.89
资产总计	14,122,938.94	-	-	87,999,651.08	102,122,590.02
负债					
应付赎回款	-	-	-	10,630,269.63	10,630,269.63
应付管理人报酬	-	-	-	13,320.56	13,320.56
应付托管费	-	-	-	4,440.16	4,440.16
应付清算款	-	-	-	1,256.93	1,256.93
应付销售服务费	-	-	-	1,349.57	1,349.57
其他负债	-	-	-	54,087.76	54,087.76
负债总计	-	-	-	10,704,724.61	10,704,724.61
利率敏感度缺口	14,122,938.94	-	-	77,294,926.47	91,417,865.41

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2025 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，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

注：不适用。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：不适用。

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。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期指数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，基金管理人将通过投资非成份股、成份股个股衍生品等方式进行替代，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。

本基金投资组合中股票（含存托凭证）资产的比例不低于基金资产的 90%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例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	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	85,733,931.02	93.78
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	85,733,931.02	93.78

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）
	业绩比较基准上升 5%	1,140,705.00
	业绩比较基准下降 5%	-1,140,705.00

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：不适用。

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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下： 第一层次：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：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值； 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	85,733,931.02
第二层次	—
第三层次	—

合计	85,733,931.02
----	---------------

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。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，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股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2025 年 06 月 30 日，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

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	85,733,931.02	83.95
	其中：股票	85,733,931.02	83.95
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	14,029,989.85	13.74
8	其他各项资产	2,358,669.15	2.31
9	合计	102,122,590.02	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	465,932.00	0.51
B	采矿业	4,318,594.00	4.72
C	制造业	49,848,446.92	54.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,642,022.00	2.89
E	建筑业	1,630,889.00	1.78
F	批发和零售业	603,351.00	0.66
G	交通运输、仓储和邮政业	2,983,210.00	3.26
H	住宿和餐饮业	73,473.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,723,412.30	6.26
J	金融业	13,814,070.00	15.11
K	房地产业	896,841.00	0.98
L	租赁和商务服务业	948,783.80	1.04
M	科学研究和技术服务业	947,545.00	1.04
N	水利、环境和公共设施管理业	185,741.00	0.20
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	56,304.00	0.06
Q	卫生和社会工作	326,826.00	0.36
R	文化、体育和娱乐业	268,490.00	0.29
S	综合	-	-
	合计	85,733,931.02	93.78

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票投资。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

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	2,300	3,241,896.00	3.55
2	300750	宁德时代	9,900	2,496,978.00	2.73
3	601318	中国平安	39,100	2,169,268.00	2.37
4	600036	招商银行	46,200	2,122,890.00	2.32
5	601166	兴业银行	62,100	1,449,414.00	1.59
6	600900	长江电力	45,700	1,377,398.00	1.51
7	000333	美的集团	18,400	1,328,480.00	1.45
8	601899	紫金矿业	61,564	1,200,498.00	1.31
9	002594	比亚迪	3,400	1,128,494.00	1.23
10	300059	东方财富	47,200	1,091,736.00	1.19
11	600030	中信证券	36,500	1,008,130.00	1.10
12	601398	工商银行	130,900	993,531.00	1.09
13	600276	恒瑞医药	16,700	866,730.00	0.95
14	000858	五粮液	7,200	856,080.00	0.94
15	601328	交通银行	99,600	796,800.00	0.87
16	000651	格力电器	16,700	750,164.00	0.82
17	601288	农业银行	119,200	700,896.00	0.77
18	688981	中芯国际	7,470	658,629.90	0.72
19	600887	伊利股份	23,600	657,968.00	0.72
20	002475	立讯精密	18,900	655,641.00	0.72
21	600919	江苏银行	54,800	654,312.00	0.72
22	603259	药明康德	9,300	646,815.00	0.71
23	601816	京沪高铁	109,600	630,200.00	0.69
24	600000	浦发银行	43,900	609,332.00	0.67
25	000725	京东方 A	137,200	547,428.00	0.60
26	002371	北方华创	1,200	530,652.00	0.58
27	300760	迈瑞医疗	2,300	516,925.00	0.57
28	601088	中国神华	12,300	498,642.00	0.55
29	688041	海光信息	3,480	491,689.20	0.54
30	300308	中际旭创	3,300	481,338.00	0.53
31	688256	寒武纪	800	481,200.00	0.53
32	601601	中国太保	12,800	480,128.00	0.53
33	300502	新易盛	3,660	464,893.20	0.51
34	300124	汇川技术	7,000	451,990.00	0.49
35	601728	中国电信	58,000	449,500.00	0.49
36	601668	中国建筑	77,200	445,444.00	0.49
37	002352	顺丰控股	9,000	438,840.00	0.48
38	000001	平安银行	36,200	436,934.00	0.48
39	002714	牧原股份	10,200	428,502.00	0.47
40	601127	赛力斯	3,100	416,392.00	0.46
41	002230	科大讯飞	8,600	411,768.00	0.45
42	603501	豪威集团	3,200	408,480.00	0.45
43	600031	三一重工	22,200	398,490.00	0.44

44	000063	中兴通讯	12,000	389,880.00	0.43
45	603019	中科曙光	5,500	387,200.00	0.42
46	002415	海康威视	13,800	382,674.00	0.42
47	600941	中国移动	3,400	382,670.00	0.42
48	600309	万华化学	7,000	379,820.00	0.42
49	300274	阳光电源	5,400	365,958.00	0.40
50	601857	中国石油	42,300	361,665.00	0.40
51	601919	中远海控	23,500	353,440.00	0.39
52	688008	澜起科技	4,290	351,780.00	0.38
53	600690	海尔智家	14,000	346,920.00	0.38
54	600660	福耀玻璃	6,000	342,060.00	0.37
55	601012	隆基绿能	22,600	339,452.00	0.37
56	600406	国电南瑞	14,700	329,427.00	0.36
57	601766	中国中车	45,400	319,616.00	0.35
58	603986	兆易创新	2,500	316,325.00	0.35
59	000338	潍柴动力	20,200	310,676.00	0.34
60	688012	中微公司	1,700	309,910.00	0.34
61	300476	胜宏科技	2,300	309,074.00	0.34
62	600050	中国联通	57,700	308,118.00	0.34
63	600028	中国石化	54,500	307,380.00	0.34
64	000568	泸州老窖	2,700	306,180.00	0.33
65	000100	TCL 科技	70,100	303,533.00	0.33
66	601988	中国银行	53,500	300,670.00	0.33
67	601006	大秦铁路	45,100	297,660.00	0.33
68	601985	中国核电	30,700	286,124.00	0.31
69	601225	陕西煤业	14,500	278,980.00	0.31
70	600104	上汽集团	17,306	277,761.30	0.30
71	002027	分众传媒	37,800	275,940.00	0.30
72	600150	中国船舶	8,400	273,336.00	0.30
73	600418	江淮汽车	6,500	260,585.00	0.29
74	601628	中国人寿	6,200	255,378.00	0.28
75	688111	金山办公	900	252,045.00	0.28
76	605499	东鹏饮料	800	251,240.00	0.27
77	603288	海天味业	6,200	241,242.00	0.26
78	600760	中航沈飞	4,100	240,342.00	0.26
79	000425	徐工机械	30,700	238,539.00	0.26
80	600111	北方稀土	9,500	236,550.00	0.26
81	000625	长安汽车	18,500	236,060.00	0.26
82	000792	盐湖股份	13,800	235,704.00	0.26
83	600938	中国海油	8,900	232,379.00	0.25
84	688271	联影医疗	1,800	229,932.00	0.25
85	600905	XD 三峡能	53,400	227,484.00	0.25
86	600089	特变电工	18,900	225,477.00	0.25

87	601658	邮储银行	41,200	225,364.00	0.25
88	002625	光启技术	5,600	223,888.00	0.24
89	002050	三花智控	8,400	221,592.00	0.24
90	600436	片仔癀	1,100	220,011.00	0.24
91	601888	中国中免	3,600	219,492.00	0.24
92	300033	同花顺	800	218,408.00	0.24
93	300015	爱尔眼科	17,400	217,152.00	0.24
94	600048	保利发展	26,800	217,080.00	0.24
95	600019	宝钢股份	32,700	215,493.00	0.24
96	601390	中国中铁	38,300	214,863.00	0.24
97	600547	山东黄金	6,700	213,931.00	0.23
98	603993	洛阳钼业	25,300	213,026.00	0.23
99	002463	沪电股份	5,000	212,900.00	0.23
100	002241	歌尔股份	9,100	212,212.00	0.23
101	600415	小商品城	10,200	210,936.00	0.23
102	300014	亿纬锂能	4,600	210,726.00	0.23
103	601600	中国铝业	29,600	208,384.00	0.23
104	601989	中国重工	42,600	197,664.00	0.22
105	000977	浪潮信息	3,800	193,344.00	0.21
106	600893	航发动力	5,000	192,700.00	0.21
107	002384	东山精密	5,100	192,627.00	0.21
108	600570	恒生电子	5,700	191,178.00	0.21
109	002179	中航光电	4,700	189,692.00	0.21
110	603799	华友钴业	5,100	188,802.00	0.21
111	600585	海螺水泥	8,600	184,642.00	0.20
112	000538	云南白药	3,300	184,107.00	0.20
113	000938	紫光股份	7,500	179,925.00	0.20
114	000988	华工科技	3,800	178,638.00	0.20
115	600584	长电科技	5,300	178,557.00	0.20
116	601727	上海电气	23,600	174,404.00	0.19
117	600438	通威股份	10,100	169,175.00	0.19
118	002028	思源电气	2,300	167,693.00	0.18
119	300408	三环集团	5,000	167,000.00	0.18
120	300433	蓝思科技	7,400	165,020.00	0.18
121	002049	紫光国微	2,500	164,650.00	0.18
122	000002	万科 A	25,400	163,068.00	0.18
123	600795	国电电力	33,300	161,172.00	0.18
124	600489	中金黄金	10,900	159,467.00	0.17
125	601669	中国电建	32,200	156,814.00	0.17
126	600988	赤峰黄金	6,200	154,256.00	0.17
127	300339	润和软件	3,000	152,490.00	0.17
128	600010	包钢股份	84,600	151,434.00	0.17
129	601689	拓普集团	3,200	151,200.00	0.17

130	002422	科伦药业	4,200	150,864.00	0.17
131	002456	欧菲光	12,400	146,940.00	0.16
132	600009	上海机场	4,600	146,142.00	0.16
133	688036	传音控股	1,822	145,213.40	0.16
134	688169	石头科技	920	144,026.00	0.16
135	601100	恒立液压	2,000	144,000.00	0.16
136	600160	巨化股份	5,000	143,400.00	0.16
137	000768	中航西飞	5,200	142,168.00	0.16
138	002460	赣锋锂业	4,200	141,834.00	0.16
139	688608	恒玄科技	400	139,192.00	0.15
140	300394	天孚通信	1,740	138,921.60	0.15
141	601186	中国铁建	17,200	137,772.00	0.15
142	002252	上海莱士	19,800	136,026.00	0.15
143	600183	生益科技	4,500	135,675.00	0.15
144	000157	中联重科	18,600	134,478.00	0.15
145	600839	四川长虹	13,800	134,136.00	0.15
146	601360	三六零	13,100	133,620.00	0.15
147	000963	华东医药	3,300	133,188.00	0.15
148	600886	国投电力	9,000	132,660.00	0.15
149	600989	宝丰能源	8,200	132,348.00	0.14
150	002074	国轩高科	4,000	129,840.00	0.14
151	600115	中国东航	32,000	128,960.00	0.14
152	300442	润泽科技	2,600	128,778.00	0.14
153	601058	赛轮轮胎	9,800	128,576.00	0.14
154	002466	天齐锂业	3,900	124,956.00	0.14
155	000807	云铝股份	7,800	124,644.00	0.14
156	600066	宇通客车	5,000	124,300.00	0.14
157	000408	藏格矿业	2,900	123,743.00	0.14
158	002517	恺英网络	6,400	123,584.00	0.14
159	002340	格林美	19,100	121,285.00	0.13
160	002001	新 和 成	5,700	121,239.00	0.13
161	002558	巨人网络	5,100	120,105.00	0.13
162	300661	圣邦股份	1,650	120,070.50	0.13
163	002195	岩山科技	21,200	119,356.00	0.13
164	600426	华鲁恒升	5,500	119,185.00	0.13
165	000661	长春高新	1,200	119,016.00	0.13
166	600029	南方航空	20,100	118,590.00	0.13
167	688506	百利天恒	400	118,448.00	0.13
168	001979	招商蛇口	13,500	118,395.00	0.13
169	601800	中国交建	13,300	118,237.00	0.13
170	600196	复星医药	4,700	117,923.00	0.13
171	002236	大华股份	7,400	117,512.00	0.13
172	000975	山金国际	6,200	117,428.00	0.13

173	600011	华能国际	16,400	117,096.00	0.13
174	600674	川投能源	7,300	117,092.00	0.13
175	688126	沪硅产业	6,220	116,438.40	0.13
176	002156	通富微电	4,500	115,290.00	0.13
177	301236	软通动力	2,100	114,744.00	0.13
178	688617	惠泰医疗	380	112,860.00	0.12
179	600346	恒力石化	7,900	112,654.00	0.12
180	300251	光线传媒	5,500	111,485.00	0.12
181	300418	昆仑万维	3,300	110,979.00	0.12
182	600745	闻泰科技	3,300	110,649.00	0.12
183	601111	中国国航	14,000	110,460.00	0.12
184	300207	欣旺达	5,500	110,330.00	0.12
185	600487	亨通光电	7,200	110,160.00	0.12
186	002648	卫星化学	6,300	109,179.00	0.12
187	600372	中航机载	9,000	108,540.00	0.12
188	601868	中国能建	48,400	107,932.00	0.12
189	002916	深南电路	1,000	107,810.00	0.12
190	003816	中国广核	29,400	107,016.00	0.12
191	600460	士兰微	4,300	106,726.00	0.12
192	000066	中国长城	7,200	106,560.00	0.12
193	600096	云天化	4,800	105,456.00	0.12
194	601117	中国化学	13,700	105,079.00	0.11
195	300896	爱美客	600	104,886.00	0.11
196	688777	中控技术	2,330	104,640.30	0.11
197	600741	华域汽车	5,900	104,135.00	0.11
198	002273	水晶光电	5,200	103,844.00	0.11
199	600879	航天电子	9,900	103,653.00	0.11
200	601319	中国人保	11,900	103,649.00	0.11
201	002465	海格通信	7,400	103,156.00	0.11
202	601168	西部矿业	6,200	103,106.00	0.11
203	600588	用友网络	7,700	102,949.00	0.11
204	600176	中国巨石	9,000	102,600.00	0.11
205	600256	广汇能源	17,000	102,340.00	0.11
206	688213	思特威	1,000	102,220.00	0.11
207	002920	德赛西威	1,000	102,130.00	0.11
208	300450	先导智能	4,100	101,885.00	0.11
209	300347	泰格医药	1,900	101,308.00	0.11
210	688120	华海清科	600	101,220.00	0.11
211	000831	中国稀土	2,800	101,136.00	0.11
212	601633	长城汽车	4,700	100,956.00	0.11
213	000786	北新建材	3,800	100,624.00	0.11
214	002601	龙佰集团	6,200	100,502.00	0.11
215	002555	三七互娱	5,800	100,282.00	0.11

216	601021	春秋航空	1,800	100,170.00	0.11
217	300782	卓胜微	1,400	99,918.00	0.11
218	600219	南山铝业	26,000	99,580.00	0.11
219	002294	信立泰	2,100	99,393.00	0.11
220	600352	浙江龙盛	9,700	98,552.00	0.11
221	000933	神火股份	5,900	98,176.00	0.11
222	600885	宏发股份	4,380	97,717.80	0.11
223	688002	睿创微纳	1,400	97,608.00	0.11
224	300017	网宿科技	9,100	97,552.00	0.11
225	600039	四川路桥	9,800	97,020.00	0.11
226	688235	百济神州	415	96,960.60	0.11
227	002185	华天科技	9,600	96,960.00	0.11
228	600482	中国动力	4,200	96,894.00	0.11
229	302132	中航成飞	1,100	96,734.00	0.11
230	000630	铜陵有色	28,700	95,858.00	0.10
231	002493	荣盛石化	11,300	93,564.00	0.10
232	688122	西部超导	1,800	93,384.00	0.10
233	688047	龙芯中科	700	93,373.00	0.10
234	002129	TCL 中环	12,100	92,928.00	0.10
235	688099	晶晨股份	1,300	92,313.00	0.10
236	688072	拓荆科技	600	92,226.00	0.10
237	600362	江西铜业	3,900	91,377.00	0.10
238	688396	华润微	1,937	91,348.92	0.10
239	001965	招商公路	7,600	91,200.00	0.10
240	300866	安克创新	800	90,880.00	0.10
241	601877	正泰电器	4,000	90,680.00	0.10
242	002709	天赐材料	5,000	90,600.00	0.10
243	002130	沃尔核材	3,800	90,516.00	0.10
244	600085	同仁堂	2,500	90,150.00	0.10
245	300223	北京君正	1,300	89,960.00	0.10
246	002085	万丰奥威	5,600	88,984.00	0.10
247	000423	东阿阿胶	1,700	88,910.00	0.10
248	002595	豪迈科技	1,500	88,830.00	0.10
249	002281	光迅科技	1,800	88,776.00	0.10
250	002131	利欧股份	25,300	88,550.00	0.10
251	300122	智飞生物	4,500	88,155.00	0.10
252	300474	景嘉微	1,200	87,600.00	0.10
253	002738	中矿资源	2,700	86,832.00	0.09
254	603129	春风动力	400	86,600.00	0.09
255	300058	蓝色光标	13,180	86,460.80	0.09
256	002532	天山铝业	10,400	86,424.00	0.09
257	300002	神州泰岳	7,300	86,140.00	0.09
258	688266	泽璟制药	800	86,008.00	0.09

259	603392	万泰生物	1,400	85,400.00	0.09
260	300832	新产业	1,500	85,080.00	0.09
261	002180	纳思达	3,700	84,878.00	0.09
262	002078	太阳纸业	6,300	84,798.00	0.09
263	300454	深信服	900	84,762.00	0.09
264	600161	天坛生物	4,400	84,436.00	0.09
265	002138	顺络电子	3,000	84,360.00	0.09
266	603596	伯特利	1,600	84,304.00	0.09
267	002472	双环传动	2,500	83,725.00	0.09
268	002436	兴森科技	6,300	83,412.00	0.09
269	002938	鹏鼎控股	2,600	83,278.00	0.09
270	002410	广联达	6,200	83,142.00	0.09
271	002128	电投能源	4,200	83,076.00	0.09
272	600233	圆通速递	6,400	82,496.00	0.09
273	000301	东方盛虹	9,900	82,467.00	0.09
274	300395	菲利华	1,600	81,760.00	0.09
275	600188	兖矿能源	6,700	81,539.00	0.09
276	600143	金发科技	7,900	81,449.00	0.09
277	300759	康龙化成	3,300	80,982.00	0.09
278	600862	中航高科	3,100	80,848.00	0.09
279	300024	机器人	4,700	80,746.00	0.09
280	002065	东华软件	8,400	80,640.00	0.09
281	300136	信维通信	3,600	80,640.00	0.09
282	002353	杰瑞股份	2,300	80,500.00	0.09
283	300346	南大光电	2,540	80,365.60	0.09
284	300054	鼎龙股份	2,800	80,304.00	0.09
285	300496	中科创达	1,400	80,108.00	0.09
286	601618	中国中冶	26,700	79,566.00	0.09
287	000034	神州数码	2,100	79,044.00	0.09
288	002202	金风科技	7,700	78,925.00	0.09
289	000999	华润三九	2,520	78,825.60	0.09
290	002223	鱼跃医疗	2,200	78,320.00	0.09
291	601615	明阳智能	6,800	78,132.00	0.09
292	688223	晶科能源	15,010	77,901.90	0.09
293	603606	东方电缆	1,500	77,565.00	0.08
294	002624	完美世界	5,100	77,367.00	0.08
295	300383	光环新网	5,400	77,220.00	0.08
296	002271	东方雨虹	7,100	76,183.00	0.08
297	002405	四维图新	8,900	76,006.00	0.08
298	601872	招商轮船	12,100	75,746.00	0.08
299	600845	宝信软件	3,200	75,584.00	0.08
300	002008	大族激光	3,100	75,547.00	0.08
301	600515	海南机场	21,300	75,402.00	0.08

302	603659	璞泰来	4,000	75,120.00	0.08
303	600895	张江高科	2,900	74,530.00	0.08
304	603605	珀莱雅	900	74,511.00	0.08
305	688578	艾力斯	800	74,432.00	0.08
306	002459	晶澳科技	7,400	73,852.00	0.08
307	300012	华测检测	6,300	73,647.00	0.08
308	300459	汤姆猫	13,100	73,360.00	0.08
309	600549	厦门钨业	3,500	73,220.00	0.08
310	002155	湖南黄金	4,100	73,185.00	0.08
311	300627	华测导航	2,080	72,800.00	0.08
312	000426	兴业银锡	4,600	72,680.00	0.08
313	605117	德业股份	1,380	72,670.80	0.08
314	300604	长川科技	1,600	71,856.00	0.08
315	688599	天合光能	4,920	71,487.60	0.08
316	603087	甘李药业	1,300	71,214.00	0.08
317	300037	新宙邦	2,000	70,400.00	0.08
318	000733	振华科技	1,400	70,070.00	0.08
319	300253	卫宁健康	6,600	69,960.00	0.08
320	300699	光威复材	2,200	69,674.00	0.08
321	601216	君正集团	12,600	69,552.00	0.08
322	605589	圣泉集团	2,500	69,375.00	0.08
323	002444	巨星科技	2,700	68,877.00	0.08
324	000617	中油资本	9,400	68,620.00	0.08
325	600332	白云山	2,600	68,536.00	0.07
326	600392	盛和资源	5,200	68,484.00	0.07
327	688180	君实生物	2,000	67,960.00	0.07
328	000519	中兵红箭	3,100	67,859.00	0.07
329	300003	乐普医疗	4,900	67,522.00	0.07
330	600153	建发股份	6,500	67,405.00	0.07
331	300001	特锐德	2,800	67,116.00	0.07
332	601233	桐昆股份	6,300	66,780.00	0.07
333	002389	航天彩虹	2,600	66,560.00	0.07
334	000932	华菱钢铁	15,100	66,440.00	0.07
335	600803	新奥股份	3,500	66,150.00	0.07
336	000878	云南铜业	5,200	66,144.00	0.07
337	300628	亿联网络	1,900	66,044.00	0.07
338	300142	沃森生物	6,000	66,000.00	0.07
339	688188	柏楚电子	500	65,830.00	0.07
340	300073	当升科技	1,500	65,805.00	0.07
341	002414	高德红外	6,400	65,600.00	0.07
342	300316	晶盛机电	2,400	65,160.00	0.07
343	603979	金诚信	1,400	65,016.00	0.07
344	600699	均胜电子	3,700	64,528.00	0.07

345	002812	恩捷股份	2,200	64,438.00	0.07
346	002007	华兰生物	4,100	64,247.00	0.07
347	300568	星源材质	5,000	63,400.00	0.07
348	600521	华海药业	3,400	63,342.00	0.07
349	600118	中国卫星	2,200	62,854.00	0.07
350	600177	雅戈尔	8,600	62,780.00	0.07
351	600398	海澜之家	9,000	62,640.00	0.07
352	601799	星宇股份	500	62,500.00	0.07
353	300315	掌趣科技	10,200	61,914.00	0.07
354	002152	广电运通	4,600	61,824.00	0.07
355	002821	凯莱英	700	61,775.00	0.07
356	603260	XD 合盛硅	1,300	61,620.00	0.07
357	601238	广汽集团	8,200	61,418.00	0.07
358	600704	物产中大	11,600	61,132.00	0.07
359	300413	芒果超媒	2,800	61,096.00	0.07
360	000623	吉林敖东	3,600	61,020.00	0.07
361	002318	久立特材	2,600	60,814.00	0.07
362	600316	洪都航空	1,600	60,320.00	0.07
363	600497	驰宏锌锗	11,400	60,306.00	0.07
364	000738	航发控制	2,900	60,175.00	0.07
365	002409	雅克科技	1,100	60,159.00	0.07
366	002044	美年健康	11,700	60,138.00	0.07
367	300757	罗博特科	400	59,988.00	0.07
368	600141	兴发集团	2,900	59,537.00	0.07
369	000009	中国宝安	6,700	59,496.00	0.07
370	600018	上港集团	10,400	59,384.00	0.06
371	600765	中航重机	3,500	59,080.00	0.06
372	000400	许继电气	2,700	58,779.00	0.06
373	601567	三星医疗	2,600	58,292.00	0.06
374	600038	中直股份	1,500	58,215.00	0.06
375	601677	明泰铝业	4,600	57,132.00	0.06
376	600498	烽火通信	2,700	56,781.00	0.06
377	000960	锡业股份	3,700	56,610.00	0.06
378	002607	中公教育	18,400	56,304.00	0.06
379	603939	益丰药房	2,300	56,281.00	0.06
380	600637	东方明珠	7,500	56,025.00	0.06
381	300919	中伟股份	1,700	55,896.00	0.06
382	300088	长信科技	9,300	55,428.00	0.06
383	601607	上海医药	3,100	55,428.00	0.06
384	002841	视源股份	1,600	55,360.00	0.06
385	002245	蔚蓝锂芯	4,300	55,169.00	0.06
386	300182	捷成股份	9,900	54,549.00	0.06
387	600563	法拉电子	500	54,545.00	0.06

388	300724	捷佳伟创	1,000	54,300.00	0.06
389	000039	中集集团	6,900	54,234.00	0.06
390	300068	南都电源	3,400	54,128.00	0.06
391	688303	大全能源	2,530	53,939.60	0.06
392	002739	万达电影	4,700	53,721.00	0.06
393	600026	中远海能	5,200	53,716.00	0.06
394	002407	多氟多	4,400	53,636.00	0.06
395	600529	山东药玻	2,400	53,136.00	0.06
396	601018	宁波港	14,500	53,070.00	0.06
397	301358	湖南裕能	1,700	53,023.00	0.06
398	603486	科沃斯	900	52,407.00	0.06
399	600486	扬农化工	900	52,200.00	0.06
400	300558	贝达药业	900	52,155.00	0.06
401	300285	国瓷材料	3,000	52,050.00	0.06
402	300763	锦浪科技	900	51,651.00	0.06
403	002025	航天电器	1,000	51,410.00	0.06
404	000887	中鼎股份	2,900	51,011.00	0.06
405	603806	福斯特	3,900	50,544.00	0.06
406	600820	隧道股份	8,200	50,020.00	0.05
407	688009	中国通号	9,700	49,858.00	0.05
408	600008	首创环保	16,500	49,830.00	0.05
409	600763	通策医疗	1,200	49,536.00	0.05
410	300296	利亚德	8,100	49,410.00	0.05
411	002497	雅化集团	4,300	49,020.00	0.05
412	002064	华峰化学	7,400	48,914.00	0.05
413	300144	宋城演艺	5,700	48,735.00	0.05
414	600516	方大炭素	10,500	48,720.00	0.05
415	600998	九州通	9,400	48,316.00	0.05
416	002312	川发龙蟒	4,200	48,216.00	0.05
417	600166	福田汽车	17,700	47,967.00	0.05
418	603568	伟明环保	2,500	47,700.00	0.05
419	600170	上海建工	19,900	47,561.00	0.05
420	601179	中国西电	7,700	47,278.00	0.05
421	600208	衢州发展	15,900	47,064.00	0.05
422	605358	立昂微	2,000	46,600.00	0.05
423	601155	新城控股	3,400	46,512.00	0.05
424	002176	江特电机	6,400	46,464.00	0.05
425	000683	博源化工	9,700	46,463.00	0.05
426	600312	平高电气	3,000	46,170.00	0.05
427	603816	顾家家居	1,800	45,936.00	0.05
428	601000	唐山港	11,100	45,066.00	0.05
429	603613	国联股份	1,900	45,011.00	0.05
430	000818	航锦科技	2,000	45,000.00	0.05

431	002244	滨江集团	4,600	44,850.00	0.05
432	300676	华大基因	900	44,793.00	0.05
433	000708	中信特钢	3,800	44,688.00	0.05
434	000629	钒钛股份	17,400	44,544.00	0.05
435	603885	吉祥航空	3,300	44,451.00	0.05
436	688005	容百科技	1,990	44,416.80	0.05
437	000830	鲁西化工	4,300	44,290.00	0.05
438	600323	瀚蓝环境	1,800	43,830.00	0.05
439	600535	天士力	2,800	43,820.00	0.05
440	002432	九安医疗	1,200	43,716.00	0.05
441	002603	以岭药业	3,100	43,710.00	0.05
442	002439	启明星辰	2,700	43,173.00	0.05
443	603000	人民网	2,100	42,441.00	0.05
444	300567	精测电子	700	42,427.00	0.05
445	600499	科达制造	4,300	42,140.00	0.05
446	601880	辽港股份	28,000	42,000.00	0.05
447	300390	天华新能	2,200	41,954.00	0.05
448	002145	中核钛白	10,000	41,500.00	0.05
449	000563	陕国投 A	11,500	41,055.00	0.04
450	600511	国药股份	1,400	40,824.00	0.04
451	603899	晨光股份	1,400	40,586.00	0.04
452	600655	豫园股份	7,300	40,515.00	0.04
453	603077	和邦生物	23,100	40,425.00	0.04
454	000547	航天发展	4,800	40,320.00	0.04
455	600859	王府井	2,900	40,281.00	0.04
456	600325	华发股份	8,200	39,934.00	0.04
457	601966	玲珑轮胎	2,700	39,609.00	0.04
458	603833	欧派家居	700	39,515.00	0.04
459	600004	白云机场	4,300	39,130.00	0.04
460	600131	国网信通	2,200	38,940.00	0.04
461	300529	健帆生物	1,800	38,826.00	0.04
462	600754	锦江酒店	1,700	38,148.00	0.04
463	002756	永兴材料	1,200	38,100.00	0.04
464	300601	康泰生物	2,500	37,975.00	0.04
465	000998	隆平高科	3,800	37,430.00	0.04
466	300070	碧水源	8,100	36,450.00	0.04
467	601866	中远海发	14,700	36,309.00	0.04
468	600667	太极实业	5,500	36,190.00	0.04
469	002120	韵达股份	5,400	36,180.00	0.04
470	600867	通化东宝	4,400	36,080.00	0.04
471	300438	鹏辉能源	1,300	35,893.00	0.04
472	600258	首旅酒店	2,500	35,325.00	0.04
473	300573	兴齐眼药	680	35,217.20	0.04

474	002544	普天科技	1,500	35,175.00	0.04
475	300751	迈为股份	500	34,780.00	0.04
476	300457	赢合科技	1,500	34,500.00	0.04
477	000032	深桑达 A	1,700	34,391.00	0.04
478	002508	老板电器	1,800	34,218.00	0.04
479	000069	华侨城 A	15,000	33,750.00	0.04
480	002831	裕同科技	1,400	32,788.00	0.04
481	000967	盈峰环境	4,700	32,665.00	0.04
482	300118	东方日升	3,400	32,572.00	0.04
483	002292	奥飞娱乐	3,300	32,076.00	0.04
484	600129	太极集团	1,500	31,965.00	0.03
485	002572	索菲亚	2,200	30,822.00	0.03
486	601636	旗滨集团	6,000	30,060.00	0.03
487	002266	浙富控股	9,700	29,876.00	0.03
488	603650	彤程新材	900	28,935.00	0.03
489	600864	哈投股份	4,700	28,059.00	0.03
490	000035	中国天楹	6,500	27,885.00	0.03
491	600315	上海家化	1,300	27,391.00	0.03
492	688063	派能科技	600	27,048.00	0.03
493	300769	德方纳米	800	26,416.00	0.03
494	002091	江苏国泰	3,600	26,172.00	0.03
495	688390	固德威	600	26,070.00	0.03
496	002372	伟星新材	2,400	24,864.00	0.03
497	001914	招商积余	1,600	19,792.00	0.02
498	600007	中国国贸	800	16,464.00	0.02
499	600335	国机汽车	2,200	14,190.00	0.02
500	301381	赛维时代	400	7,980.00	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

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票投资。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	7,517,085.00	8.22
2	300750	宁德时代	4,782,195.00	5.23
3	601318	中国平安	4,156,489.00	4.55
4	600036	招商银行	3,999,847.00	4.38
5	000333	美的集团	2,740,340.00	3.00
6	600900	长江电力	2,687,676.00	2.94
7	601166	兴业银行	2,549,242.00	2.79
8	002594	比亚迪	2,447,997.00	2.68

9	601899	紫金矿业	2, 213, 888. 56	2. 42
10	300059	东方财富	2, 038, 298. 00	2. 23
11	000858	五 粮 液	1, 936, 676. 00	2. 12
12	600030	中信证券	1, 904, 341. 00	2. 08
13	601398	工商银行	1, 858, 049. 00	2. 03
14	600276	恒瑞医药	1, 679, 709. 00	1. 84
15	000651	格力电器	1, 549, 505. 00	1. 69
16	600887	伊利股份	1, 413, 921. 00	1. 55
17	688981	中芯国际	1, 356, 097. 46	1. 48
18	601328	交通银行	1, 340, 749. 00	1. 47
19	601816	京沪高铁	1, 304, 664. 00	1. 43
20	601288	农业银行	1, 287, 457. 00	1. 41

注：本项“买入金额”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。

7.4.2 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	3, 863, 281. 00	4. 23
2	300750	宁德时代	2, 565, 890. 00	2. 81
3	601318	中国平安	2, 295, 076. 00	2. 51
4	600036	招商银行	2, 134, 586. 00	2. 33
5	600900	长江电力	1, 416, 865. 00	1. 55
6	000333	美的集团	1, 403, 757. 00	1. 54
7	601166	兴业银行	1, 292, 895. 00	1. 41
8	002594	比亚迪	1, 232, 471. 00	1. 35
9	601899	紫金矿业	1, 131, 332. 00	1. 24
10	300059	东方财富	1, 057, 195. 00	1. 16
11	600030	中信证券	987, 869. 00	1. 08
12	601398	工商银行	976, 358. 00	1. 07
13	000858	五 粮 液	963, 930. 00	1. 05
14	600276	恒瑞医药	905, 566. 00	0. 99
15	000651	格力电器	791, 451. 00	0. 87
16	600887	伊利股份	721, 327. 00	0. 79
17	601288	农业银行	692, 588. 00	0. 76
18	601816	京沪高铁	669, 425. 00	0. 73
19	688981	中芯国际	649, 597. 77	0. 71
20	600919	江苏银行	622, 602. 00	0. 68

注：本项“卖出金额”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。

7.4.3 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	168, 343, 544. 03
卖出股票收入（成交）总额	85, 787, 124. 23

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货时，将严格根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等。股指期货的投资主要采用流动性好、交易活跃的合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作，力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

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

本基金投资范围未包括国债期货，无相关投资政策。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金投资范围未包括国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体在报告编制日前一年内受到处罚如下：

兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局福建监管局的行政处罚。

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定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	92,949.09
2	应收清算款	450,141.89
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	1,815,578.17
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	2,358,669.15

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的股票。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，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（%）
中银证券 中证 A500 指数 A	1,497	53,807.07	—	—	80,549,182.99	100.00
中银证券	175	47,731.88	—	—	8,353,079.34	100.00

中证 A500 指数 C						
合计	1,672	53,171.21	-	-	88,902,262.33	100.00

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	中银证券中证 A500 指数 A	198,647.21	0.2466
	中银证券中证 A500 指数 C	191,952.85	2.2980
	合计	390,600.06	0.4394

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

项目	份额级别	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	中银证券中证 A500 指数 A	10~50
	中银证券中证 A500 指数 C	-
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	中银证券中证 A500 指数 A	-
	中银证券中证 A500 指数 C	-
	合计	-

注：本基金本报告期末本基金基金经理未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中银证券中证 A500 指数 A	中银证券中证 A500 指数 C
基金合同生效日 （2025 年 3 月 19 日） 基金份额总额	254,218,565.24	45,770,973.49
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	4,223,207.11	3,371,419.97
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	177,892,589.36	40,789,314.12
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	80,549,182.99	8,353,079.34

§ 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

2025 年 1 月, 根据《公司法》和《公司章程》等有关规定, 公司工会组织公司员工通过民主选举方式推选洪浩先生为公司第二届监事会职工监事, 任期自选举通过之日起至第二届监事会届满之日止。2025 年 3 月, 公司监事、监事会主席何涛先生因工作安排原因申请辞去监事、监事会主席职务, 辞任后将不在公司担任任何职务。2025 年 6 月, 董事王蕾女士因工作安排原因申请辞去公司第二届董事会董事、战略与发展委员会委员职务。2025 年 6 月, 公司 2024 年年度股东大会审议通过《关于选举公司第二届董事会非独立董事的议案》, 选举卢莹女士担任公司董事。2025 年 6 月, 董事长宁敏女士因工作调动原因申请辞去公司第二届董事会董事长、董事、战略与发展委员会主任委员、风险控制委员会委员、法定代表人职务。为保证公司正常运作, 根据《公司章程》有关规定, 公司于 2025 年 6 月 23 日召开第二届董事会第三十六次会议, 审议通过了《关于推举周冰先生代为履行公司董事长、法定代表人职责的议案》。经全体董事推举, 由公司董事、执行总裁周冰先生代为履行董事长、董事会战略与发展委员会主任委员以及法定代表人职责。2025 年 6 月, 聘任盖文国兼任公司合规总监、公募基金管理业务合规负责人。自 2025 年 6 月 9 日起, 公司执行总裁周冰先生不再代为履行合规总监兼公募基金管理业务合规负责人职责。赵青伟先生自 2025 年 6 月 27 日起不再担任公司资管总监。

本报告期, 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

一、本报告期内, 本基金管理人无涉及基金管理业务的诉讼, 公司其他主要诉讼、仲裁事项请参见《中银国际证券股份有限公司 2025 年半年度报告》;

二、本报告期内, 无涉及基金财产的诉讼事项;

三、本报告期内, 无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，公司基金管理业务未有管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况，其他受处罚情况请参见《中银国际证券股份有限公司 2025 年半年度报告》。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

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 (%)	
中银证券	2	254,130,668.26	100.00	49,790.43	100.00	-

注：1、由于交易所系统限制，本基金管理人作为上海和深圳证券交易所的会员单位目前尚不能再租用其他证券公司的交易单元。

2、今后基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

3、今后基金专用交易席位的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构。
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券	成交金额	占当期债券回购成交总	成交金额	占当期权证
		券		回购成交总		证

		成交总额 的比例 (%)		额的比例 (%)		成交总额 的比例 (%)
中银证 券	52,017,252. 44	100.00	433,155,000. 00	100.00	-	-

注：1、由于交易所系统限制，本基金管理人作为上海和深圳证券交易所的会员单位目前尚不能再租用其他证券公司的交易单元。

2、今后基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1)经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3)具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

3、今后基金专用交易席位的选择程序如下：

- (1)本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构。
- (2)基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中银证券中证 A500 指数型证券投资基金基金份额发售公告	规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 2 月 18 日
2	中银证券中证 A500 指数型证券投资基金基金合同	公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 2 月 18 日
3	中银证券中证 A500 指数型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 2 月 18 日
4	中银证券中证 A500 指数型证券投资基金托管协议	公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 2 月 18 日
5	中银证券中证 A500 指数型证券投资基金招募说明书	公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 2 月 18 日
6	中银证券中证 A500 指数型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要	公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 2 月 18 日
7	中银证券中证 A500 指数型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要	公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 2 月 18 日
8	关于增加中国邮政储蓄银行股份有限公司为中银证券中证 A500 指数型证	规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 2 月 26 日

	券投资基金销售机构的公告	露网站	
9	中银国际证券股份有限公司关于中银证券中证 A500 指数型证券投资基金投资关联方证券的公告	规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 3 月 20 日
10	中银证券中证 A500 指数型证券投资基金基金合同生效公告	规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 3 月 20 日
11	中银国际证券股份有限公司旗下公募基金通过证券公司交易及佣金支付情况公告	规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 3 月 28 日
12	中银证券中证 A500 指数型证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资及转换业务的公告	规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 4 月 24 日
13	中银国际证券股份有限公司关于高级管理人员变更的公告	上交所、深交所、规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 6 月 10 日
14	中银国际证券股份有限公司关于董事长变更及执行总裁代为履行董事长职务的公告	上交所、深交所、规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 6 月 25 日
15	中银国际证券股份有限公司关于高级管理人员变更的公告	上交所、深交所、规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 6 月 28 日

注：全部公告均在公司网站披露, 部分公告在公司网站及报纸披露。

§ 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

注：本基金报告期内未有单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情况。

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、中国证监会准予本基金募集注册的文件
- 2、基金合同
- 3、托管协议
- 4、法律意见书

5、基金管理人业务资格批件和营业执照

6、基金托管人业务资格批件和营业执照

7、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可以在开放时间内至基金管理人或基金托管人住所免费查阅，也可登录基金管理人基金网站 www.bocifunds.com 查阅。

中银国际证券股份有限公司

2025 年 8 月 30 日