

中银证券中证 500 交易型开放式指数证券 投资基金 2026 年中期报告

2026 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告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 2026 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	7
§ 4 管理人报告	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合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	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	41
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	54
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	54

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	55
§ 8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
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	56
§ 9 开放式基金份额变动	56
§ 10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
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	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4 基金投资策略的改变	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	57
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	58
10.8 其他重大事件	59
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	60
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
§ 12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录	61
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	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	中银证券中证 500ETF
场内简称	BOCI500 扩位简称：中证 500ETF 中银证券
基金主代码	515190
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 4 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	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	267,466,080.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020 年 5 月 27 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。
投资策略	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。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的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。同时本基金为交易型开放式指数基金，采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	盖文国	张姗
	联系电话	021-20328000	400-61-95555
	电子邮箱	gmkf@bocichina.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		956026, 400-620-8888	400-61-95555
传真		021-50372474	0755-83195201

注册地址	上海市浦东新区银城中路 200 号 中银大厦 39F	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	上海市浦东新区银城中路 200 号 中银大厦 39F	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	200120	518040
法定代表人	周权	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.bocifunds.com
基金中期报告置备地点	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
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 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	109,011,400.75
本期利润	133,001,997.07
加权平均基金份额本期利润	0.3751
本期加权平均净值利润率	21.86%
本期基金份额净值增长率	21.71%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	238,630,349.37
期末可供分配基金份额利润	0.8922
期末基金资产净值	506,096,429.37
期末基金份额净值	1.8922
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	89.22%

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

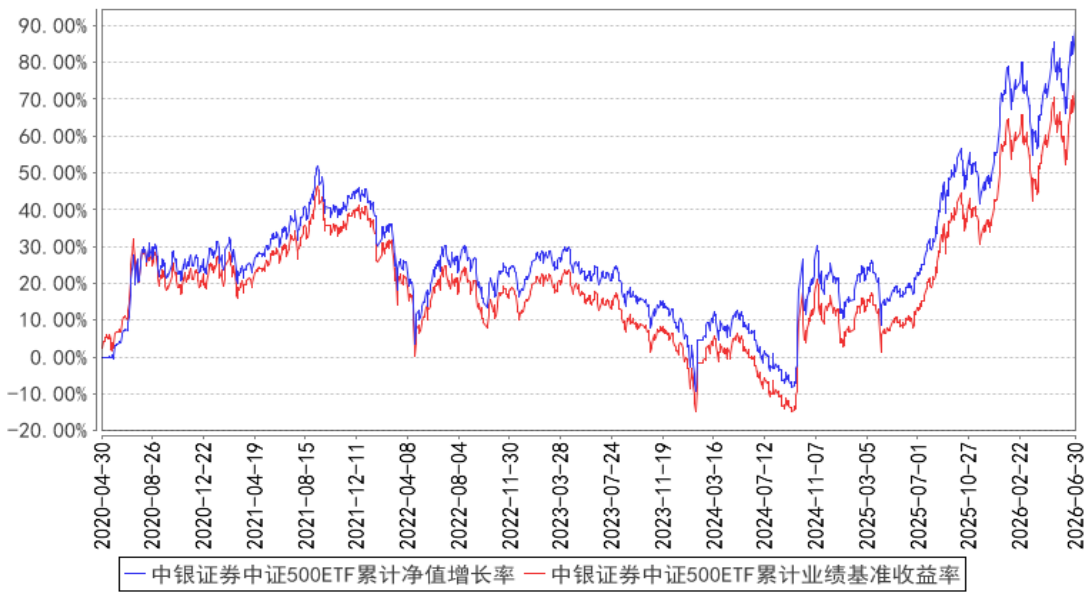
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	19.39%	1.64%	18.56%	1.65%	0.83%	-0.01%
过去六个月	21.71%	1.65%	20.97%	1.66%	0.74%	-0.01%
过去一年	54.23%	1.41%	52.68%	1.42%	1.55%	-0.01%
过去三年	55.15%	1.47%	50.55%	1.49%	4.60%	-0.02%
过去五年	40.12%	1.35%	32.65%	1.36%	7.47%	-0.01%
自基金合同生效起至今	89.22%	1.32%	72.79%	1.34%	16.43%	-0.02%

注：业绩比较基准=中证 500 指数收益率。

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500ETF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：本基金合同生效日为 2020 年 4 月 30 日。

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

第 7 页 共 61 页

在上海成立，注册资本 27.78 亿元人民币。截至 2026 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、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、中国建设银行股份有限公司—华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、杨竣凯、香港中央结算有限公司、朱晔、刘龙贵、付卫平。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 2026 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 43 只证券投资基金，包括：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、中银证券安怡债券型证券投资基金、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、中银证券创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

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		
张艺敏	本基金的基金经理	2020 年 9 月 15 日	—	8 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、中银证券创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中银证券中证科创创业人工智能交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
刘先政	本基金的基金经理	2025 年 8 月 18 日	—	9 年	刘先政，硕士研究生，中国国籍，已取得证券、基金从业资格。曾任太平基金管理有限公司资深行业研究员、百年保险资产管理有限公司高级权益投资经理；2017 年 11 月至 2021 年 4 月任职于诺德基金管理有限公司，担任基金经理；2021 年 4 月加入中银国际证券股份有限公司，历任中银证券安泰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、中银证券成长领航混合型证券投资基金基金经理，现任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，不存在损害基金份额持有人利益的行为、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

上半年权益市场上涨，中证 500 指数表现为 20.97%，高于沪深 300、万得全 A。上半年对指数涨幅正贡献最大的三大成分行业为电子、通信、基础化工，负贡献最大的三大成分行业为汽车、传媒、非银行金融。截至 6 月底，中证 500 指数滚动市盈率 42.02 倍，处于过去五年 100%左右分

位。报告期内标的指数完成一次成分股定期调整，电子、基础化工、医药、通信、石油石化等行业的占比小幅提升，有色金属、机械、计算机、传媒、国防军工等行业的占比小幅下降。

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。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

截至本报告期末本基金份额净值为 1.8922 元；本报告期基金份额净值增长率为 21.71%，业绩比较基准收益率为 20.97%。

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 A 股整体震荡上行、板块间分化加剧。科技成长板块显著领跑全市场，电子、通信板块上半年的涨幅分别为 85.49%、74.54%，远超其他行业。涨幅排第 3 的建材行业上半年的涨幅为 43.70%，其主要权重股同样受益于 AI 产业，AI 服务器对高频高速高多层 PCB 需求激增带来的电子布消耗量上升。沪深 300、上证指数温和上行，上半年涨幅分别为 7.55%、3.16%。一季度中东冲突、海外流动性预期的扰动压制了风险偏好，引发市场行情阶段性回调。二季度以来，随着冲突有所缓和，加上 AI 产业高景气带动，A 股市场主线集中在科技成长方向。电子、通信行业二季度单季度的涨幅分别达到 89.88%、66.12%。A 股市场成交活跃度维持在相对高位、交易集中度抬升，科技板块成交占比上升。基本面方面，科技、资源品相关的上市公司盈利增速较高，但国内需求修复仍呈结构性分化，内需修复力度不足。

预计下半年全球 AI 产业的需求有望持续，对我国出口的支撑较强。全球 AI 产业的发展将继续带动我国科技产业贡献增量，产业链相关企业的盈利有望继续上行。消费端受制于收入预期、就业率以及房地产价格低迷等因素影响，整体修复预计有限。展望 A 股后市，我们认为在稳定和增强资本市场信心的政策基调与适度宽松的货币环境下，市场行情向好的基础仍在。

中证 500 指数作为中小盘成长风格的宽基指数，在流动性相对宽松的环境下相较大盘指数具有一定弹性优势，同时均衡分散的行业结构能够更从容地应对市场行业主题轮动。本基金作为一只投资于中证 500 的指数产品，将继续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等因素对指数跟踪效果带来的冲击，降低本基金的跟踪误差，为投资者提供一个标准化的中证 500 指数投资工具。

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。由分管运营服务部的公司领导担任主席，成员

由分管公募投资部的公司领导、公募投资部、资管业务管理部、内控与法律合规部、风险管理部、运营服务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

托管人声明：

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

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

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

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在

虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	2,805,260.66	9,537,348.46
结算备付金		591,480.59	575,194.92
存出保证金		242,636.73	122,014.54
交易性金融资产	6.4.7.2	503,377,213.83	810,861,375.64
其中：股票投资		503,172,208.41	810,779,374.38
基金投资		-	-
债券投资		205,005.42	82,001.26
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		1,173,489.22	13,463,626.27
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	60,492.63	-
资产总计		508,250,573.66	834,559,559.83
负 债 和 净 资 产			
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		1,927,384.10	17,331,955.60
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		66,739.78	84,116.95
应付托管费		22,246.61	28,038.97
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.31	0.07
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	137,773.49	184,170.56
负债合计		2,154,144.29	17,628,282.15
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	267,466,080.00	525,466,080.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	238,630,349.37	291,465,197.68
净资产合计		506,096,429.37	816,931,277.68
负债和净资产总计		508,250,573.66	834,559,559.83

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.8922 元，基金份额总额 267,466,080.00 份。

6.2 利润表

会计主体：中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		133,759,443.30	3,864,925.29
1. 利息收入		9,212.06	1,244.44
其中：存款利息收入	6.4.7.13	9,212.06	1,244.44
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）		107,404,554.69	1,201,977.52
其中：股票投资收益	6.4.7.14	103,819,932.35	348,686.02
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	126,872.36	3,355.74
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-

收益			
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	3,457,749.98	849,935.76
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	23,990,596.32	2,616,200.10
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	2,355,080.23	45,503.23
减：二、营业总支出		757,446.23	254,111.07
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	455,938.23	64,990.58
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	151,979.41	21,663.60
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		0.05	-
8. 其他费用	6.4.7.23	149,528.54	167,456.89
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		133,001,997.07	3,610,814.22
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		133,001,997.07	3,610,814.22
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		133,001,997.07	3,610,814.22

6.3 净资产变动表

会计主体：中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净	525,466,080.00	-	291,465,197.68	816,931,277.68

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	525,466,080.00	-	291,465,197.68	816,931,277.68
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-258,000,000.00	-	-52,834,848.31	-310,834,848.31
（一）、综合收益总额	-	-	133,001,997.07	133,001,997.07
（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）	-258,000,000.00	-	-185,836,845.38	-443,836,845.38
其中：1. 基金申购款	212,000,000.00	-	145,539,014.86	357,539,014.86
2. 基金赎回款	-470,000,000.00	-	-331,375,860.24	-801,375,860.24
（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	267,466,080.00	-	238,630,349.37	506,096,429.37
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	75,466,080.00	-	13,504,369.16	88,970,449.16
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	75,466,080.00	-	13,504,369.16	88,970,449.16
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-4,000,000.00	-	2,710,432.76	-1,289,567.24
(一)、综合收益总额	-	-	3,610,814.22	3,610,814.22
(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)	-4,000,000.00	-	-900,381.46	-4,900,381.46
其中：1. 基金申购款	6,000,000.00	-	1,218,949.58	7,218,949.58
2. 基金赎回款	-10,000,000.00	-	-2,119,331.04	-12,119,331.04
(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	71,466,080.00	-	16,214,801.92	87,680,881.92

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

沈锋

金坚

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]2052 号《关于准予中银证券中证 500 交易型开放式指数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

《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息(含募集股票市值)共募集人民币 251,438,000.00 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第 0351 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2020 年 4 月 30 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 251,466,080.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 28,080.00 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，基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2020]135 号文核准，本基金于 2020 年 5 月 27 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银证券中证 500 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及其备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金还可投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证)、股指期货、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债的纯债部分、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持债券、政府支持机构债券等)、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款和其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、资产支持证券、债券回购以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率。

本基金的基金管理人中银国际证券股份有限公司以本基金为目标 ETF，募集成立了中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“中证 500ETF 联接基金”)。中证 500ETF 联接基金为交易型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

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，同时亦按照中国证券投资基金业协会(以下简称“基金业协会”)颁布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3

号——年度报告和中期报告》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他在财务报表附注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要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 06 月 30 日的财务状况，自 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[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[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、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》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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》、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 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值

税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b) 对本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。

对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对本基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）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。对本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。

对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

d) 本基金卖出股票按 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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

e) 对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	2,805,260.66
等于：本金	2,804,816.74
加：应计利息	443.92
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	2,805,260.66

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		440,172,069.53	-	503,172,208.41	63,000,138.88
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	205,000.00	5.42	205,005.42	0.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	205,000.00	5.42	205,005.42	0.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		440,377,069.53	5.42	503,377,213.83	63,000,138.88

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	60,492.63
合计	60,492.63

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	51,318.84
其中：交易所市场	51,318.84
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	86,454.65
合计	137,773.49

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	525,466,080.00	525,466,080.00
本期申购	212,000,000.00	212,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-470,000,000.00	-470,000,000.00
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	267,466,080.00	267,466,080.00

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	309,254,086.35	-17,788,888.67	291,465,197.68
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	309,254,086.35	-17,788,888.67	291,465,197.68
本期利润	109,011,400.75	23,990,596.32	133,001,997.07
本期基金份额交易产生的变动数	-177,888,768.71	-7,948,076.67	-185,836,845.38
其中：基金申购款	152,874,281.72	-7,335,266.86	145,539,014.86
基金赎回款	-330,763,050.43	-612,809.81	-331,375,860.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	240,376,718.39	-1,746,369.02	238,630,349.37

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	7,117.84
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	1,689.09
其他	405.13
合计	9,212.06

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	74,132,367.82
股票投资收益——赎回差价收入	29,687,564.53
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	103,819,932.35

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	599,227,023.61
减：卖出股票成本总额	524,540,910.86
减：交易费用	553,744.93
买卖股票差价收入	74,132,367.82

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 2026年1月1日至2026年6月30日
赎回基金份额对价总额	801,375,860.24
减：现金支付赎回款总额	416,160,666.24
减：赎回股票成本总额	355,527,629.47
减：交易费用	—
赎回差价收入	29,687,564.53

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益-申购差价收入。

6.4.7.14.5 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 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	11.89
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	126,860.47
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	126,872.36

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	277,579.72
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	150,700.00
减：应计利息总额	8.15
减：交易费用	11.10
买卖债券差价收入	126,860.47

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：本基金本报告期内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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,457,749.98
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	3,457,749.98

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	23,990,596.32
股票投资	23,990,596.32
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	23,990,596.32

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	2,355,080.23
合计	2,355,080.23

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

6.4.7.22 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	17,030.29
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	3,398.92
其他费用	69,591.96
合计	149,528.54

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、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况
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、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
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
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（“中证 500ETF 联接基金”）	基金管理人管理的其他基金
国机重型装备集团股份有限公司（“国机重装”）	基金管理人的关联方

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
中银证券	977,288,375.51	100.00	30,559,685.36	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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	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 成交总额的比例（%）
中银证券	277,579.72	100.00	14,256.32	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间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 2026年1月1日至2026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	191,461.50	100.00	51,318.84	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1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	5,988.69	100.00	3,767.06	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、因我司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，我司旗下公募基金参与证券交易仅能使用我司自有交易席位进行，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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	455,938.23	64,990.58
其中：应支付销售机构的客户维护费	98.57	42.37
应支付基金管理人的净管理费	455,839.66	64,948.21

注：支付基金管理人中银证券的基金管理费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。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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年
----	--------------------------------	-----------------------------------

	月 30 日	6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	151, 979. 41	21, 663. 60

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无支付给各关联方的销售服务费。

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：本基金本报告期内及上年度可比期间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：本基金本报告期内及上年度可比期间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：本基金本报告期内及上年度可比期间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：本基金的基金管理人于本基金本报告期内及上年度可比期间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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
中证500ETF联接基金	213, 221, 480. 00	79. 7191	401, 254, 680. 00	76. 3617

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	2,805,260.66	7,117.84	795,254.68	1,179.30

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，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：本基金本报告期内及上年度可比期间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

为更紧密地跟踪标的指数，降低跟踪误差，本基金在报告期内投资于关联方发行的普通股中银证券（601696.SH）和国机重装（601399.SH）。

于本报告期末，本基金持有中银证券 74,000 股，占基金净值比例 0.20%（上年度末：本基金持有中银证券 144,600 股，占基金净值比例 0.27%）。

于本报告期末，本基金持有国机重装 128,200 股，占基金净值比例 0.09%（上年度末：本基金持有国机重装 249,900 股，占基金净值比例 0.15%）。

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（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
111025	圣泉转债	2026 年 6 月 25 日	1 个月（含）	新债未上市	100.00	100.00	980	98,000.00	98,001.29	-
113704	春风转债	2026 年 6 月 10 日	1 个月（含）	新债未上市	100.00	100.00	790	79,000.00	79,003.64	-
118071	华峰转债	2026 年 6 月 23 日	1 个月（含）	新债未上市	100.00	100.00	280	28,000.00	28,000.49	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
400174	中天 3	2023 年 8 月 30 日	暂停转让	0.00	-	-	44,600	126,944.97	0.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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 500 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 500 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。

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、总裁办公会、风险管理委员会、风险管理部、公募投资部、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。总裁办公会领导公司基金业务的风险管理。风险管理委员会协助总裁办公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、资管业务管理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。财务管理部、运营服务部、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，将风险控制在可接受的范围内。

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招商银行，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：本基金本报告期末及上年度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：本基金本报告期末及上年度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：本基金本报告期末及上年度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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	205,005.42	82,001.26
未评级	-	-

合计	205,005.42	82,001.26
----	------------	-----------

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度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：本基金本报告期末及上年度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来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于 2026 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。本基金赎回基金采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

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、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金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 2026 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 2026 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、存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,805,260.66	-	-	-	2,805,260.66
结算备付金	591,480.59	-	-	-	591,480.59
存出保证金	242,636.73	-	-	-	242,636.73
交易性金融资产	205,005.42	-	-	503,172,208.41	503,377,213.83
应收清算款	-	-	-	1,173,489.22	1,173,489.22
其他资产	-	-	-	60,492.63	60,492.63
资产总计	3,844,383.40	-	-	504,406,190.26	508,250,573.66
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	66,739.78	66,739.78
应付托管费	-	-	-	22,246.61	22,246.61
应付清算款	-	-	-	1,927,384.10	1,927,384.10
应交税费	-	-	-	0.31	0.31
其他负债	-	-	-	137,773.49	137,773.49
负债总计	-	-	-	2,154,144.29	2,154,144.29
利率敏感度缺口	3,844,383.40	-	-	502,252,045.97	506,096,429.37
上年度末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2025 年 12 月 31 日					
资产					
货币资金	9,537,348.46	-	-	-	9,537,348.46
结算备付金	575,194.92	-	-	-	575,194.92
存出保证金	122,014.54	-	-	-	122,014.54
交易性金融资产	82,001.26	-	-	810,779,374.38	810,861,375.64
应收清算款	-	-	-	13,463,626.27	13,463,626.27
资产总计	10,316,559.18	-	-	824,243,000.65	834,559,559.83
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	84,116.95	84,116.95
应付托管费	-	-	-	28,038.97	28,038.97
应付清算款	-	-	-	17,331,955.60	17,331,955.60
应交税费	-	-	-	0.07	0.07
其他负债	-	-	-	184,170.56	184,170.56
负债总计	-	-	-	17,628,282.15	17,628,282.15
利率敏感度缺口	10,316,559.18	-	-	806,614,718.50	816,931,277.68

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 2026 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净资产的比例为 0.04%（2025 年 12 月 31 日：0.01%），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（2025 年 12 月 31 日：同）。

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。

本基金投资于标的指数成份股及其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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	503,172,208.41	99.42	810,779,374.38	99.25
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	503,172,208.41	99.42	810,779,374.38	99.25

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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	25,148,602.24	40,569,964.45

	业绩比较基准下降 5%	-25, 148, 602. 24	-40, 569, 964. 45
--	----------------	-------------------	-------------------

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	503, 172, 208. 41	810, 779, 374. 38
第二层次	205, 005. 42	82, 001. 26
第三层次	-	-
合计	503, 377, 213. 83	810, 861, 375. 64

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 2026 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(2025 年 12 月

31 日：同)。

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	503,172,208.41	99.00
	其中：股票	503,172,208.41	99.00
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	205,005.42	0.04
	其中：债券	205,005.42	0.04
	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	3,396,741.25	0.67
8	其他各项资产	1,476,618.58	0.29
9	合计	508,250,573.66	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,643,403.00	0.32
B	采矿业	15,468,492.20	3.06
C	制造业	378,893,387.61	74.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,156,894.10	2.40
E	建筑业	2,952,854.00	0.58
F	批发和零售业	9,539,948.27	1.89
G	交通运输、仓储和	6,086,021.00	1.20

	邮政业		
H	住宿和餐饮业	361,599.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	32,533,812.41	6.43
J	金融业	27,477,648.72	5.43
K	房地产业	2,019,017.00	0.40
L	租赁和商务服务业	5,134,631.40	1.01
M	科学研究和技术服务业	3,661,132.82	0.72
N	水利、环境和公共设施管理业	1,728,555.96	0.34
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	1,175,462.92	0.23
R	文化、体育和娱乐业	2,339,348.00	0.46
S	综合	—	—
	合计	503,172,208.41	99.42

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	—	—
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	—	—
K	房地产业	0.00	0.00
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	-	-

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。

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	688498	源杰科技	4,600	8,675,600.00	1.71
2	300604	长川科技	20,000	6,828,400.00	1.35
3	001309	德明利	6,900	6,506,010.00	1.29
4	688347	华虹宏力	17,894	6,017,752.20	1.19
5	688120	华海清科	17,322	5,580,801.96	1.10
6	002281	光迅科技	21,400	5,498,516.00	1.09
7	002008	大族激光	36,500	5,479,015.00	1.08
8	300857	协创数据	15,260	5,186,874.00	1.02
9	300136	信维通信	43,100	5,139,675.00	1.02
10	688361	中科飞测	10,400	4,472,000.00	0.88
11	300475	香农芯创	14,700	4,410,000.00	0.87
12	300223	北京君正	17,300	4,305,970.00	0.85
13	002436	兴森科技	75,500	3,846,725.00	0.76
14	300285	国瓷材料	35,400	3,652,572.00	0.72
15	300054	鼎龙股份	33,700	3,571,189.00	0.71
16	600105	永鼎股份	52,000	3,508,960.00	0.69
17	300666	江丰电子	9,300	3,427,980.00	0.68
18	688200	华峰测控	6,400	3,360,640.00	0.66
19	300757	罗博特科	5,400	3,342,600.00	0.66
20	688777	中控技术	28,300	3,325,250.00	0.66
21	688037	芯源微	7,400	3,248,970.00	0.64
22	000021	深科技	48,900	3,142,803.00	0.62
23	002851	麦格米特	18,300	3,059,394.00	0.60
24	601869	长飞光纤	5,600	3,057,040.00	0.60
25	300548	长芯博创	10,400	2,891,200.00	0.57
26	300346	南大光电	30,900	2,862,885.00	0.57
27	002409	雅克科技	12,700	2,851,150.00	0.56
28	688019	安集科技	8,360	2,837,885.60	0.56
29	300567	精测电子	8,600	2,731,360.00	0.54

30	002407	多氟多	53,000	2,662,190.00	0.53
31	600498	烽火通信	36,100	2,656,960.00	0.52
32	002185	华天科技	118,200	2,637,042.00	0.52
33	002138	顺络电子	35,800	2,616,980.00	0.52
34	688002	睿创微纳	16,416	2,539,391.04	0.50
35	300395	菲利华	18,900	2,527,497.00	0.50
36	688313	仕佳光子	13,665	2,523,242.25	0.50
37	600879	航天电子	117,400	2,499,446.00	0.49
38	688017	绿的谐波	5,900	2,465,374.00	0.49
39	300620	光库科技	6,500	2,458,300.00	0.49
40	300390	天华新能	25,810	2,413,493.10	0.48
41	688469	芯联集成	223,700	2,373,457.00	0.47
42	301526	国际复材	50,200	2,342,834.00	0.46
43	300373	扬杰科技	14,500	2,279,835.00	0.45
44	300058	蓝色光标	159,640	2,196,646.40	0.43
45	688702	盛科通信	5,592	2,180,824.08	0.43
46	002273	水晶光电	61,200	2,171,376.00	0.43
47	300037	新宙邦	23,376	2,170,461.60	0.43
48	688172	燕东微	25,400	2,124,964.00	0.42
49	603256	宏和科技	7,900	2,096,107.00	0.41
50	301377	鼎泰高科	3,800	2,093,420.00	0.41
51	300751	迈为股份	7,300	2,061,958.00	0.41
52	605358	立昂微	26,400	2,048,640.00	0.40
53	600988	赤峰黄金	73,900	1,945,048.00	0.38
54	605589	圣泉集团	30,200	1,919,814.00	0.38
55	688099	晶晨股份	18,600	1,913,940.00	0.38
56	600885	宏发股份	55,132	1,901,502.68	0.38
57	002738	中矿资源	32,220	1,900,657.80	0.38
58	000960	锡业股份	44,000	1,878,360.00	0.37
59	002126	银轮股份	37,600	1,872,480.00	0.37
60	600392	盛和资源	62,300	1,854,671.00	0.37
61	000831	中国稀土	33,200	1,842,268.00	0.36
62	600601	方正科技	133,100	1,842,104.00	0.36
63	600141	兴发集团	37,400	1,756,678.00	0.35
64	001389	广合科技	7,400	1,755,650.00	0.35
65	002812	恩捷股份	26,200	1,753,042.00	0.35
66	600378	昊华科技	22,800	1,718,664.00	0.34
67	688234	天岳先进	9,873	1,713,064.23	0.34
68	300570	太辰光	6,900	1,702,299.00	0.34
69	301358	湖南裕能	22,400	1,699,488.00	0.34
70	601179	中国西电	113,900	1,699,388.00	0.34
71	002195	岩山科技	252,300	1,650,042.00	0.33
72	600497	驰宏锌锗	134,600	1,630,006.00	0.32

73	002850	科达利	8,500	1,609,050.00	0.32
74	688629	华丰科技	8,500	1,593,835.00	0.31
75	002261	拓维信息	56,100	1,571,361.00	0.31
76	600157	永泰能源	970,700	1,562,827.00	0.31
77	688052	纳芯微	5,243	1,511,609.33	0.30
78	600711	盛屯矿业	137,600	1,509,472.00	0.30
79	002340	格林美	227,000	1,500,470.00	0.30
80	600909	华安证券	134,110	1,489,962.10	0.29
81	600143	金发科技	95,200	1,470,840.00	0.29
82	688411	海博思创	5,000	1,456,000.00	0.29
83	300017	网宿科技	111,200	1,446,712.00	0.29
84	301200	大族数控	4,000	1,442,600.00	0.29
85	000783	长江证券	147,700	1,440,075.00	0.28
86	002131	利欧股份	301,100	1,430,225.00	0.28
87	688027	国盾量子	2,837	1,429,876.37	0.28
88	003031	中瓷电子	7,840	1,413,552.00	0.28
89	002821	凯莱英	8,700	1,409,400.00	0.28
90	601555	东吴证券	176,950	1,401,444.00	0.28
91	600352	浙江龙盛	115,700	1,401,127.00	0.28
92	002203	海亮股份	61,000	1,393,850.00	0.28
93	002966	苏州银行	198,870	1,384,135.20	0.27
94	601233	桐昆股份	63,400	1,372,610.00	0.27
95	603659	璞泰来	47,400	1,371,282.00	0.27
96	301611	珂玛科技	7,600	1,368,532.00	0.27
97	300339	润和软件	35,300	1,359,403.00	0.27
98	688235	百济神州	5,255	1,337,975.55	0.26
99	300759	康龙化成	46,200	1,336,566.00	0.26
100	688220	翱捷科技	10,662	1,325,499.84	0.26
101	688213	思特威	12,124	1,298,116.68	0.26
102	603308	应流股份	21,000	1,268,400.00	0.25
103	688578	艾力斯	11,607	1,267,484.40	0.25
104	688122	西部超导	20,043	1,258,900.83	0.25
105	002472	双环传动	30,300	1,257,753.00	0.25
106	603129	春风动力	4,900	1,253,420.00	0.25
107	300001	特锐德	33,100	1,252,173.00	0.25
108	601108	财通证券	144,600	1,250,790.00	0.25
109	300207	欣旺达	65,700	1,247,643.00	0.25
110	002517	恺英网络	75,900	1,233,375.00	0.24
111	002797	第一创业	187,000	1,228,590.00	0.24
112	300458	全志科技	31,080	1,226,416.80	0.24
113	002601	龙佰集团	74,100	1,221,168.00	0.24
114	601958	金钼股份	43,200	1,214,352.00	0.24
115	688387	信科移动	60,700	1,204,288.00	0.24

116	688322	奥比中光	9,200	1,201,060.00	0.24
117	600563	法拉电子	6,200	1,182,960.00	0.23
118	300115	长盈精密	42,300	1,181,862.00	0.23
119	688301	奕瑞科技	9,505	1,178,620.00	0.23
120	601198	东兴证券	86,500	1,175,535.00	0.23
121	688385	复旦微电	16,458	1,173,290.82	0.23
122	601991	大唐发电	165,600	1,172,448.00	0.23
123	002155	湖南黄金	48,500	1,157,695.00	0.23
124	000703	恒逸石化	85,200	1,156,164.00	0.23
125	002465	海格通信	88,200	1,126,314.00	0.22
126	601665	齐鲁银行	191,800	1,106,686.00	0.22
127	300454	深信服	11,500	1,106,300.00	0.22
128	002056	横店东磁	36,100	1,100,328.00	0.22
129	603179	新泉股份	22,120	1,098,258.00	0.22
130	603156	养元饮品	22,300	1,094,261.00	0.22
131	600884	杉杉股份	80,100	1,085,355.00	0.21
132	300024	机器人	55,800	1,078,614.00	0.21
133	600707	彩虹股份	63,800	1,077,582.00	0.21
134	603650	彤程新材	10,900	1,067,982.00	0.21
135	002130	沃尔核材	56,100	1,063,656.00	0.21
136	002402	和而泰	41,100	1,061,613.00	0.21
137	688331	荣昌生物	8,118	1,057,450.68	0.21
138	601162	天风证券	313,600	1,056,832.00	0.21
139	000060	中金岭南	138,500	1,048,445.00	0.21
140	002429	兆驰股份	100,500	1,044,195.00	0.21
141	300012	华测检测	74,700	1,035,342.00	0.20
142	603379	三美股份	13,560	1,029,068.40	0.20
143	000878	云南铜业	64,700	1,027,436.00	0.20
144	002432	九安医疗	14,500	1,024,860.00	0.20
145	601099	太平洋	303,200	1,021,784.00	0.20
146	300496	中科创达	16,500	1,019,535.00	0.20
147	600109	国金证券	115,300	1,012,334.00	0.20
148	002271	东方雨虹	85,200	1,011,324.00	0.20
149	002414	高德红外	75,900	1,006,434.00	0.20
150	000893	亚钾国际	24,600	1,005,894.00	0.20
151	688676	金盘科技	11,838	1,001,968.32	0.20
152	000034	神州数码	36,040	1,000,110.00	0.20
153	002444	巨星科技	32,000	995,200.00	0.20
154	300474	景嘉微	16,400	991,872.00	0.20
155	603979	金诚信	16,800	991,704.00	0.20
156	688266	泽璟制药	8,500	991,610.00	0.20
157	603688	石英股份	12,000	991,320.00	0.20
158	002487	大金重工	17,100	991,287.00	0.20

159	300623	捷捷微电	22,000	989,780.00	0.20
160	689009	九号公司	25,925	989,038.75	0.20
161	000733	振华科技	17,400	985,536.00	0.19
162	002335	科华数据	23,190	984,415.50	0.19
163	600256	广汇能源	199,100	983,554.00	0.19
164	688728	格科微	46,456	977,434.24	0.19
165	600298	安琪酵母	27,000	977,400.00	0.19
166	000661	长春高新	14,600	972,360.00	0.19
167	600060	海信视像	34,700	967,089.00	0.19
168	002756	永兴材料	16,900	957,216.00	0.19
169	300763	锦浪科技	10,500	948,675.00	0.19
170	601128	常熟银行	162,401	945,173.82	0.19
171	600699	均胜电子	43,600	942,196.00	0.19
172	300748	金力永磁	30,540	942,159.00	0.19
173	300073	当升科技	19,600	941,584.00	0.19
174	301536	星宸科技	7,300	939,583.00	0.19
175	601696	中银证券	74,000	936,100.00	0.18
176	601577	XD 长沙银	107,400	935,454.00	0.18
177	603920	世运电路	19,400	931,976.00	0.18
178	601615	明阳智能	80,500	931,385.00	0.18
179	002078	太阳纸业	74,400	929,256.00	0.18
180	300142	沃森生物	71,300	926,187.00	0.18
181	002157	正邦科技	329,100	924,771.00	0.18
182	002025	航天电器	12,100	922,262.00	0.18
183	600021	上海电力	61,100	920,777.00	0.18
184	300432	富临精工	45,800	920,122.00	0.18
185	603606	东方电缆	21,880	908,238.80	0.18
186	603087	甘李药业	16,000	908,160.00	0.18
187	300919	中伟新材	20,700	905,625.00	0.18
188	000423	东阿阿胶	19,900	902,664.00	0.18
189	688169	石头科技	9,500	902,215.00	0.18
190	688608	恒玄科技	5,367	897,308.73	0.18
191	300953	震裕科技	6,700	895,790.00	0.18
192	002252	上海莱士	205,500	891,870.00	0.18
193	688599	天合光能	62,400	881,088.00	0.17
194	688343	云天励飞	10,732	876,375.12	0.17
195	300724	捷佳伟创	12,400	875,440.00	0.17
196	000728	国元证券	114,800	859,852.00	0.17
197	688375	国博电子	8,203	855,572.90	0.17
198	603290	斯达半导	5,500	841,170.00	0.17
199	002064	华峰化学	88,200	837,018.00	0.17
200	603119	浙江荣泰	12,600	835,884.00	0.17
201	688018	乐鑫科技	6,453	825,467.76	0.16

202	000786	北新建材	45,600	824,904.00	0.16
203	001203	大中矿业	27,300	817,635.00	0.16
204	002831	裕同科技	22,817	811,372.52	0.16
205	600171	上海贝岭	25,200	804,888.00	0.16
206	688180	君实生物	23,782	804,307.24	0.16
207	688188	柏楚电子	7,480	798,116.00	0.16
208	300383	光环新网	63,900	794,916.00	0.16
209	300677	英科医疗	20,240	792,800.80	0.16
210	300679	电连技术	13,200	791,868.00	0.16
211	603806	福斯特	46,600	782,414.00	0.15
212	000519	中兵红箭	37,100	781,697.00	0.15
213	300972	万辰集团	4,500	780,345.00	0.15
214	002673	西部证券	119,300	774,257.00	0.15
215	600516	方大炭素	125,400	773,718.00	0.15
216	600177	雅戈尔	102,700	773,331.00	0.15
217	000559	万向钱潮	59,200	765,456.00	0.15
218	603160	汇顶科技	12,400	765,204.00	0.15
219	688187	时代电气	11,131	764,254.46	0.15
220	601699	潞安环能	53,200	759,696.00	0.15
221	600642	申能股份	86,900	758,637.00	0.15
222	000623	吉林敖东	42,600	755,298.00	0.15
223	688065	凯赛生物	15,746	753,446.10	0.15
224	002624	完美世界	60,200	747,684.00	0.15
225	600637	东方明珠	89,600	744,576.00	0.15
226	300699	光威复材	25,880	741,462.00	0.15
227	001696	宗申动力	35,500	738,755.00	0.15
228	688568	中科星图	17,700	734,019.00	0.15
229	002085	万丰奥威	66,100	733,049.00	0.14
230	000750	国海证券	198,900	731,952.00	0.14
231	000983	山西焦煤	126,100	731,380.00	0.14
232	603225	新凤鸣	37,200	730,980.00	0.14
233	002318	久立特材	30,500	728,950.00	0.14
234	300558	贝达药业	11,200	728,784.00	0.14
235	603345	安井食品	9,000	721,710.00	0.14
236	002739	儒意电影	75,000	720,000.00	0.14
237	603444	吉比特	2,000	716,840.00	0.14
238	600100	同方股份	104,300	714,455.00	0.14
239	600369	西南证券	177,500	713,550.00	0.14
240	002065	东华软件	99,600	711,144.00	0.14
241	002266	浙富控股	139,530	706,021.80	0.14
242	600499	科达制造	51,100	705,180.00	0.14
243	600595	中孚实业	125,000	702,500.00	0.14
244	688617	惠泰医疗	3,866	701,910.96	0.14

245	002044	美年健康	139,500	701,685.00	0.14
246	300627	华测导航	24,640	699,776.00	0.14
247	600536	中国软件	24,849	698,753.88	0.14
248	603596	伯特利	27,992	695,321.28	0.14
249	603699	纽威股份	13,800	694,140.00	0.14
250	000155	川能动力	57,600	690,048.00	0.14
251	000629	钒钛股份	206,500	689,710.00	0.14
252	688772	珠海冠宇	35,101	689,032.63	0.14
253	002223	鱼跃医疗	26,800	687,688.00	0.14
254	000400	许继电气	31,500	683,550.00	0.14
255	300002	神州泰岳	87,400	682,594.00	0.13
256	601016	节能风电	174,590	677,409.20	0.13
257	000032	深桑达 A	27,000	673,650.00	0.13
258	000415	渤海租赁	165,300	672,771.00	0.13
259	300003	乐普医疗	56,700	671,895.00	0.13
260	600985	淮北矿业	47,800	671,590.00	0.13
261	601216	君正集团	150,300	670,338.00	0.13
262	601212	白银有色	131,700	669,036.00	0.13
263	600862	中航高科	37,100	668,913.00	0.13
264	002430	杭氧股份	21,600	668,736.00	0.13
265	600521	华海药业	46,400	668,160.00	0.13
266	601997	贵阳银行	130,000	666,900.00	0.13
267	601717	中创智领	47,900	666,289.00	0.13
268	000683	博源化工	115,600	665,856.00	0.13
269	000039	中集集团	82,050	665,425.50	0.13
270	300487	蓝晓科技	11,250	662,062.50	0.13
271	600863	华能蒙电	139,600	656,120.00	0.13
272	603766	隆鑫通用	54,900	654,957.00	0.13
273	600704	物产中大	138,200	652,304.00	0.13
274	601001	晋控煤业	37,200	646,908.00	0.13
275	002841	视源股份	18,700	645,711.00	0.13
276	000050	深天马 A	65,000	644,150.00	0.13
277	601990	南京证券	98,000	643,860.00	0.13
278	600873	梅花生物	87,200	640,920.00	0.13
279	688538	和辉光电	246,000	639,600.00	0.13
280	603077	和邦生物	274,900	637,768.00	0.13
281	600312	平高电气	36,100	637,526.00	0.13
282	688692	达梦数据	2,600	635,154.00	0.13
283	000729	燕京啤酒	62,600	634,138.00	0.13
284	600332	白云山	31,400	629,256.00	0.12
285	603605	珀莱雅	10,500	629,160.00	0.12
286	000967	盈峰环境	59,600	627,588.00	0.12
287	000887	中鼎股份	35,000	626,150.00	0.12

288	600765	中航重机	48,220	623,002.40	0.12
289	600166	福田汽车	211,300	614,883.00	0.12
290	600348	华阳股份	80,300	614,295.00	0.12
291	600153	建发股份	77,300	612,989.00	0.12
292	688297	中无人机	14,700	610,785.00	0.12
293	688615	合合信息	5,380	608,478.00	0.12
294	002939	长城证券	72,000	600,480.00	0.12
295	000830	鲁西化工	49,900	598,800.00	0.12
296	000062	深圳华强	18,800	598,216.00	0.12
297	002410	广联达	73,300	598,128.00	0.12
298	688582	芯动联科	9,200	598,000.00	0.12
299	601611	中国核建	53,600	597,640.00	0.12
300	002007	华兰生物	48,600	592,434.00	0.12
301	600901	江苏金租	103,000	592,250.00	0.12
302	601799	星宇股份	6,500	589,030.00	0.12
303	002683	广东宏大	20,100	588,729.00	0.12
304	600737	中粮糖业	47,400	584,442.00	0.12
305	600363	联创光电	16,100	576,058.00	0.11
306	600578	京能电力	89,200	575,340.00	0.11
307	002926	华西证券	70,200	573,534.00	0.11
308	000737	北方铜业	42,400	560,528.00	0.11
309	603728	鸣志电器	9,200	560,464.00	0.11
310	603568	伟明环保	36,432	560,324.16	0.11
311	000591	太阳能	121,700	559,820.00	0.11
312	600398	海澜之家	106,900	559,087.00	0.11
313	000921	海信家电	20,400	557,328.00	0.11
314	002603	以岭药业	37,100	556,500.00	0.11
315	603298	杭叉集团	23,200	553,552.00	0.11
316	000528	柳 工	72,700	548,885.00	0.11
317	601000	唐山港	131,800	546,970.00	0.11
318	600486	扬农化工	10,710	542,997.00	0.11
319	688114	华大智造	10,628	542,878.24	0.11
320	688248	南网科技	7,799	539,534.82	0.11
321	600316	洪都航空	19,300	539,242.00	0.11
322	600208	衢州发展	189,400	536,002.00	0.11
323	000738	航发控制	29,200	534,068.00	0.11
324	600008	首创环保	195,810	532,603.20	0.11
325	603341	龙旗科技	12,500	531,125.00	0.10
326	600998	九州通	112,389	527,104.41	0.10
327	600170	上海建工	237,100	526,362.00	0.10
328	600435	北方导航	46,900	525,280.00	0.10
329	600995	南网储能	42,700	525,210.00	0.10
330	000987	越秀资本	66,990	523,861.80	0.10

331	002152	广电运通	55,300	518,714.00	0.10
332	603486	科沃斯	10,200	517,650.00	0.10
333	000997	新大陆	31,700	516,710.00	0.10
334	600820	隧道股份	98,100	511,101.00	0.10
335	600161	天坛生物	44,100	510,678.00	0.10
336	002262	恩华药业	27,100	508,125.00	0.10
337	000932	华菱钢铁	145,400	504,538.00	0.10
338	600282	南钢股份	109,800	503,982.00	0.10
339	601106	中国一重	152,700	503,910.00	0.10
340	600483	福能股份	49,400	503,386.00	0.10
341	688778	厦钨新能	9,245	502,928.00	0.10
342	000009	中国宝安	80,300	500,269.00	0.10
343	688295	中复神鹰	8,238	498,728.52	0.10
344	603885	吉祥航空	48,400	498,036.00	0.10
345	600583	海油工程	98,500	495,455.00	0.10
346	000951	中国重汽	25,300	493,603.00	0.10
347	603816	顾家家居	21,800	487,448.00	0.10
348	002500	山西证券	94,430	487,258.80	0.10
349	603939	益丰药房	26,972	484,956.56	0.10
350	600546	山煤国际	44,200	483,106.00	0.10
351	000582	北部湾港	44,900	481,777.00	0.10
352	600763	通策医疗	13,984	473,777.92	0.09
353	600329	达仁堂	12,700	472,694.00	0.09
354	601666	平煤股份	65,900	471,185.00	0.09
355	688318	财富趋势	6,600	470,646.00	0.09
356	601567	三星电气	31,400	469,116.00	0.09
357	600685	中船防务	18,400	468,096.00	0.09
358	600562	国睿科技	22,000	466,840.00	0.09
359	003022	联泓新科	18,000	466,200.00	0.09
360	600038	中直股份	18,400	465,336.00	0.09
361	603338	浙江鼎力	10,900	463,250.00	0.09
362	600602	云赛智联	28,700	461,496.00	0.09
363	002312	川发龙蟒	50,300	461,251.00	0.09
364	000723	美锦能源	137,300	459,955.00	0.09
365	688166	博瑞医药	13,078	457,860.78	0.09
366	000513	丽珠集团	15,800	456,462.00	0.09
367	601156	东航物流	28,300	456,196.00	0.09
368	603565	中谷物流	46,500	456,165.00	0.09
369	300676	华大基因	13,000	455,780.00	0.09
370	600390	五矿资本	99,700	454,632.00	0.09
371	601880	辽港股份	327,500	451,950.00	0.09
372	601399	国机重装	128,200	448,700.00	0.09
373	600380	健康元	47,600	448,392.00	0.09

374	601865	福莱特	42,400	445,624.00	0.09
375	600132	重庆啤酒	10,700	441,910.00	0.09
376	600511	国药股份	16,900	440,076.00	0.09
377	688281	华秦科技	8,752	439,612.96	0.09
378	688336	三生国健	8,248	437,968.80	0.09
379	600535	天士力	33,000	436,590.00	0.09
380	600906	财达证券	57,900	431,934.00	0.09
381	601236	红塔证券	62,800	428,296.00	0.08
382	000739	普洛药业	25,700	428,162.00	0.08
383	600816	建元信托	175,300	427,732.00	0.08
384	600977	中国电影	33,000	426,360.00	0.08
385	000598	兴蓉环境	66,400	426,288.00	0.08
386	300100	双林股份	15,300	425,034.00	0.08
387	002244	滨江集团	55,400	421,040.00	0.08
388	002299	圣农发展	27,700	419,932.00	0.08
389	600970	中材国际	58,500	417,105.00	0.08
390	601155	新城控股	40,200	412,452.00	0.08
391	300735	光弘科技	18,100	411,594.00	0.08
392	600967	内蒙一机	37,800	410,130.00	0.08
393	002120	韵达股份	64,400	409,584.00	0.08
394	300146	汤臣倍健	45,300	409,512.00	0.08
395	000883	湖北能源	94,500	408,240.00	0.08
396	300144	宋城演艺	70,200	407,862.00	0.08
397	688278	特宝生物	7,461	405,878.40	0.08
398	000027	深圳能源	63,400	393,080.00	0.08
399	000800	一汽解放	65,700	390,915.00	0.08
400	300718	长盛轴承	6,400	390,208.00	0.08
401	600131	国网信通	26,700	389,820.00	0.08
402	601608	中信重工	81,600	389,232.00	0.08
403	003021	兆威机电	4,400	384,340.00	0.08
404	002568	百润股份	22,700	384,084.00	0.08
405	601866	中远海发	173,600	383,656.00	0.08
406	600095	湘财股份	50,800	382,524.00	0.08
407	603737	三棵树	15,813	381,093.30	0.08
408	000088	盐田港	92,500	378,325.00	0.07
409	601118	海南橡胶	76,000	373,920.00	0.07
410	002583	海能达	48,400	372,196.00	0.07
411	600801	华新建材	23,800	371,280.00	0.07
412	600126	杭钢股份	59,900	367,187.00	0.07
413	600871	石化油服	180,700	366,821.00	0.07
414	600566	济川药业	16,500	366,135.00	0.07
415	688363	华熙生物	10,200	364,854.00	0.07
416	603000	人民网	24,500	362,355.00	0.07

417	002984	森麒麟	27,700	362,039.00	0.07
418	600754	锦江酒店	20,100	361,599.00	0.07
419	000709	河钢股份	183,900	356,766.00	0.07
420	600517	国网英大	76,200	356,616.00	0.07
421	600655	豫园股份	86,400	355,104.00	0.07
422	603589	口子窖	18,800	351,184.00	0.07
423	301606	绿联科技	5,700	347,814.00	0.07
424	000825	太钢不锈	101,200	345,092.00	0.07
425	600598	北大荒	31,800	344,712.00	0.07
426	601598	中国外运	68,900	341,744.00	0.07
427	603858	步长制药	23,400	341,640.00	0.07
428	688192	迪哲医药	8,500	339,405.00	0.07
429	603899	晨光股份	16,400	338,332.00	0.07
430	002423	中粮资本	41,000	337,430.00	0.07
431	002773	康弘药业	16,500	337,425.00	0.07
432	600350	山东高速	30,200	336,126.00	0.07
433	688709	成都华微	8,800	335,192.00	0.07
434	600004	白云机场	46,000	333,960.00	0.07
435	601966	玲珑轮胎	32,700	333,213.00	0.07
436	600663	陆家嘴	52,500	329,700.00	0.07
437	600582	天地科技	73,500	327,075.00	0.06
438	001286	陕西能源	31,900	323,466.00	0.06
439	688349	三一重能	21,149	321,041.82	0.06
440	600848	上海临港	42,700	319,823.00	0.06
441	688563	航材股份	6,200	317,626.00	0.06
442	000429	粤高速 A	23,200	316,680.00	0.06
443	601098	中南传媒	32,100	315,864.00	0.06
444	002508	老板电器	20,900	305,558.00	0.06
445	600968	海油发展	90,400	301,032.00	0.06
446	600062	华润双鹤	18,590	298,183.60	0.06
447	601928	凤凰传媒	33,800	297,102.00	0.06
448	003035	南网能源	50,500	293,910.00	0.06
449	300957	贝泰妮	9,300	293,043.00	0.06
450	603233	大参林	19,410	291,732.30	0.06
451	300888	稳健医疗	10,280	287,737.20	0.06
452	600688	上海石化	98,000	287,140.00	0.06
453	688425	铁建重工	71,300	286,626.00	0.06
454	601808	中海油服	26,300	284,303.00	0.06
455	002670	国盛证券	25,800	283,800.00	0.06
456	600295	鄂尔多斯	26,400	283,008.00	0.06
457	688561	奇安信	11,732	281,333.36	0.06
458	688708	佳驰科技	5,500	279,400.00	0.06
459	002032	苏泊尔	6,900	273,240.00	0.05

460	000539	粤电力 A	39,600	269,676.00	0.05
461	600808	马钢股份	106,200	265,500.00	0.05
462	600098	广州发展	44,700	264,177.00	0.05
463	002153	石基信息	36,340	262,738.20	0.05
464	000537	绿发电力	35,900	262,429.00	0.05
465	600292	电投水电	21,300	256,452.00	0.05
466	600377	宁沪高速	21,900	253,383.00	0.05
467	601298	青岛港	31,300	251,965.00	0.05
468	000959	首钢股份	69,100	242,541.00	0.05
469	603833	欧派家居	8,000	240,880.00	0.05
470	002265	建设工业	13,800	240,120.00	0.05
471	301301	川宁生物	29,900	237,406.00	0.05
472	002608	江苏国信	33,400	230,460.00	0.05
473	603786	科博达	5,600	229,096.00	0.05
474	600339	中油工程	74,400	228,408.00	0.05
475	600032	浙江新能	32,214	227,108.70	0.04
476	600606	绿地控股	187,600	226,996.00	0.04
477	603529	爱玛科技	11,500	224,365.00	0.04
478	301498	乖宝宠物	5,500	223,245.00	0.04
479	688520	神州细胞	6,501	222,399.21	0.04
480	000785	居然智家	111,000	222,000.00	0.04
481	600764	中国海防	12,600	219,618.00	0.04
482	603658	安图生物	7,500	217,650.00	0.04
483	601139	深圳燃气	38,400	217,344.00	0.04
484	000937	冀中能源	51,790	206,124.20	0.04
485	300140	节能环保	41,400	205,758.00	0.04
486	000898	鞍钢股份	106,200	198,594.00	0.04
487	603049	中策橡胶	4,400	197,164.00	0.04
488	688475	萤石网络	7,200	196,920.00	0.04
489	603175	超颖电子	2,200	195,998.00	0.04
490	601228	广州港	67,200	189,504.00	0.04
491	601019	山东出版	26,900	172,160.00	0.03
492	002945	华林证券	12,000	161,160.00	0.03
493	600927	永安期货	12,900	160,605.00	0.03
494	601112	振石股份	8,400	153,132.00	0.03
495	002461	珠江啤酒	19,900	150,643.00	0.03
496	600299	安迪苏	17,900	140,515.00	0.03
497	688819	天能股份	6,200	137,640.00	0.03
498	603092	德力佳	1,600	86,352.00	0.02
499	001221	悍高集团	1,800	72,396.00	0.01
500	001386	马可波罗	4,900	69,384.00	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	400174	中天 3	44,600	0.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688498	源杰科技	7,650,182.76	0.94
2	001309	德明利	6,391,909.00	0.78
3	301308	江波龙	6,341,484.00	0.78
4	300751	迈为股份	4,909,954.00	0.60
5	688120	华海清科	4,372,130.56	0.54
6	300666	江丰电子	3,446,075.00	0.42
7	300475	香农芯创	3,357,965.00	0.41
8	600105	永鼎股份	3,271,736.00	0.40
9	300857	协创数据	3,063,174.00	0.37
10	300548	长芯博创	3,005,184.00	0.37
11	002281	光迅科技	3,002,488.00	0.37
12	002850	科达利	2,983,265.00	0.37
13	688525	佰维存储	2,954,843.23	0.36
14	688313	仕佳光子	2,900,474.23	0.36
15	601869	长飞光纤	2,862,177.00	0.35
16	688037	芯源微	2,810,993.83	0.34
17	300620	光库科技	2,790,838.00	0.34
18	000426	兴业银锡	2,747,127.00	0.34
19	002008	大族激光	2,678,902.00	0.33
20	300136	信维通信	2,575,985.00	0.32

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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	301308	江波龙	12,809,893.08	1.57
2	600487	亨通光电	10,327,581.00	1.26
3	002353	杰瑞股份	9,023,836.00	1.10
4	002156	通富微电	7,571,499.00	0.93
5	000426	兴业银锡	7,519,669.00	0.92
6	300450	先导智能	7,135,889.00	0.87
7	002202	金风科技	7,118,000.00	0.87
8	688525	佰维存储	7,117,978.63	0.87
9	002837	英维克	6,927,967.05	0.85
10	000657	中钨高新	6,682,046.00	0.82

11	300751	迈为股份	6,253,870.00	0.77
12	300857	协创数据	6,012,993.20	0.74
13	300136	信维通信	5,900,841.40	0.72
14	002281	光迅科技	5,671,953.00	0.69
15	000933	神火股份	5,662,292.00	0.69
16	002008	大族激光	5,558,701.00	0.68
17	002532	天山铝业	5,393,974.00	0.66
18	002558	巨人网络	5,356,823.00	0.66
19	300604	长川科技	5,036,416.00	0.62
20	300058	蓝色光标	4,539,326.00	0.56

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	378,061,351.90
卖出股票收入（成交）总额	599,227,023.61

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

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）	205,005.42	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	205,005.42	0.04

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	111025	圣泉转债	980	98,001.29	0.02
2	113704	春风转债	790	79,003.64	0.02
3	118071	华峰转债	280	28,000.49	0.01

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货，无相关投资政策。

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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同约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	242,636.73
2	应收清算款	1,173,489.22
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	60,492.63
8	其他	-
9	合计	1,476,618.58

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

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	400174	中天 3	0.00	0.00	重大事项停牌

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

8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
1,056	253,282.27	237,620,280.00	88.84	29,845,800.00	11.16

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例（%）
中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	213,221,480.00	79.7191

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本基金本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

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

注：本基金本报告期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理均未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020 年 4 月 30 日）	251,466,080.00
--------------------------	----------------

基金份额总额	
本报告期期初基金份额总额	525,466,080.00
本报告期基金总申购份额	212,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	470,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	267,466,080.00

§ 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

本报告期，基金管理人无涉及基金管理业务的重大人事变动，公司其他董事、监事、高级管理人员变动情况请参见《中银国际证券股份有限公司 2026 年半年度报告》。

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 2026 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

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，公司基金管理业务未有管理人受调查或处罚等情况，其他受处罚情况请参见《中银国际证券股份有限公司 2026 年半年度报告》。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，公司基金管理业务未有从业人员受调查或处罚等情况，其他受处罚情况请参见《中银国际证券股份有限公司 2026 年半年度报告》。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中银证券	6	977,288,375.51	100.00	191,461.50	100.00	-

注：1、由于交易所系统限制，本基金管理人作为上海、深圳和北京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。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
中银证	277,579.72	100.00	-	-	-	-

券						
---	--	--	--	--	--	--

注：1、由于交易所系统限制，本基金管理人作为上海、深圳和北京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服务；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	中银国际证券股份有限公司关于中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金变更扩位简称的公告	上交所、规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 1 月 8 日
2	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	上交所、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 1 月 8 日
3	中银国际证券股份有限公司旗下基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 1 月 22 日
4	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第四季度报告	上交所、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 1 月 22 日
5	中银国际证券股份有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 3 月 31 日
6	中银国际证券股份有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 3 月 31 日
7	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年年度报告	上交所、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 3 月 31 日

8	中银国际证券股份有限公司对外行使投票表决权（2025 年度）情况信息披露	公司官网	2026 年 4 月 11 日
9	中银国际证券股份有限公司旗下基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 4 月 21 日
10	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2026 年第一季度报告	上交所、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 4 月 21 日
11	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	上交所、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 6 月 27 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	20260101-20260630	401, 254, 680. 00	117, 212, 900. 00	305, 246, 100. 00	213, 221, 480. 00	79. 7191
产品特有风险							
本基金由于存在单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况，如遇市场行情突变可能存在大额赎回甚至巨额赎回的风险，增加基金管理人的流动性管理压力。同时，基金管理人应付赎回的变现行为可能使基金资产净值受到不利影响或者产生较大波动。本基金管理人后期将审慎评估大额申购对基金持有集中度的影响，避免单一投资者集中度继续提高，同时将完善流动性风险风险管控机制，加强对基金持有人利益的保护。							

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

2026 年 8 月 31 日