

中银证券中证 A500 指数型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：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：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。

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	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	14
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	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56
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	56
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	57

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	57
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	57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
7.12 投资组合报告附注	57
§ 8 基金份额持有人信息	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
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	59
§ 9 开放式基金份额变动	59
§ 10 重大事件揭示	60
10.1 基金份额持有人大会决议	60
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	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
10.4 基金投资策略的改变	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	60
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	60
10.8 其他重大事件	62
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	63
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	63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	63
§ 12 备查文件目录	63
12.1 备查文件目录	63
12.2 存放地点	63
12.3 查阅方式	63

§ 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	47,693,973.82 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	40,501,000.68 份	7,192,973.14 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	010-68858126
	电子邮箱	gmkf@bocichina.com	zhanglixue@psbcoa.com.cn
客户服务电话		956026, 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	周权	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 和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	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	4,547,662.58	855,965.41
本期利润	6,203,984.17	1,129,518.98
加权平均基金份 额本期利润	0.1473	0.1351
本期加权平均净 值利润率	11.26%	10.36%
本期基金份额净 值增长率	12.01%	11.90%
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	10,475,780.23	1,833,494.46
期末可供分配基 金份额利润	0.2587	0.2549
期末基金资产净 值	56,578,896.08	10,020,016.68
期末基金份额净 值	1.3970	1.3930

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	39.70%	39.30%

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
过去三个月	14.00%	1.32%	13.54%	1.34%	0.46%	-0.02%
过去六个月	12.01%	1.21%	11.34%	1.22%	0.67%	-0.01%
过去一年	35.84%	1.08%	34.41%	1.09%	1.43%	-0.01%
自基金合同生效起至今	39.70%	0.97%	30.82%	1.09%	8.88%	-0.12%

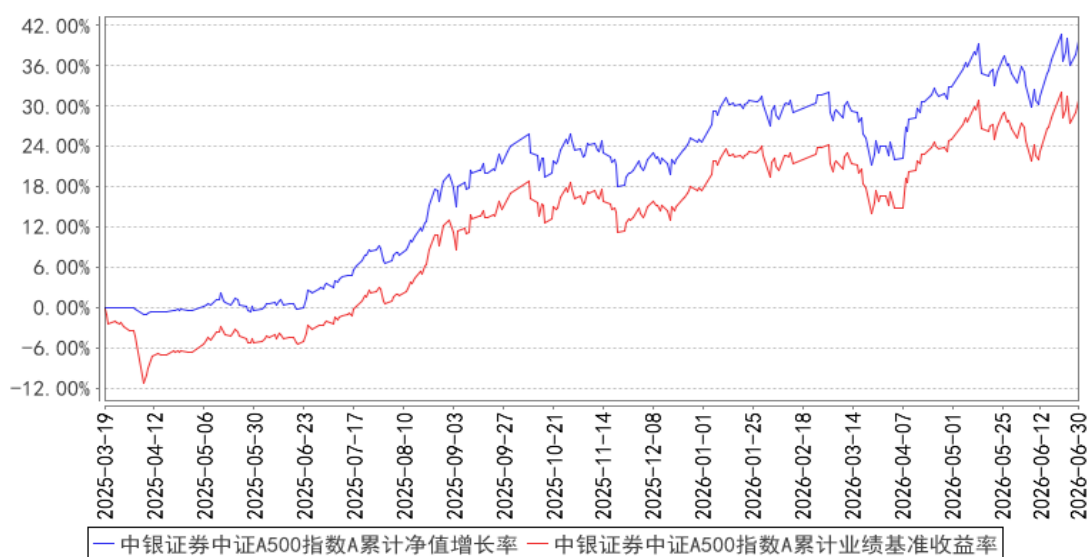
中银证券中证 A500 指数 C

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
过去三个月	13.94%	1.32%	13.54%	1.34%	0.40%	-0.02%
过去六个月	11.90%	1.21%	11.34%	1.22%	0.56%	-0.01%
过去一年	35.55%	1.08%	34.41%	1.09%	1.14%	-0.01%
自基金合同生效起至今	39.30%	0.97%	30.82%	1.09%	8.48%	-0.12%

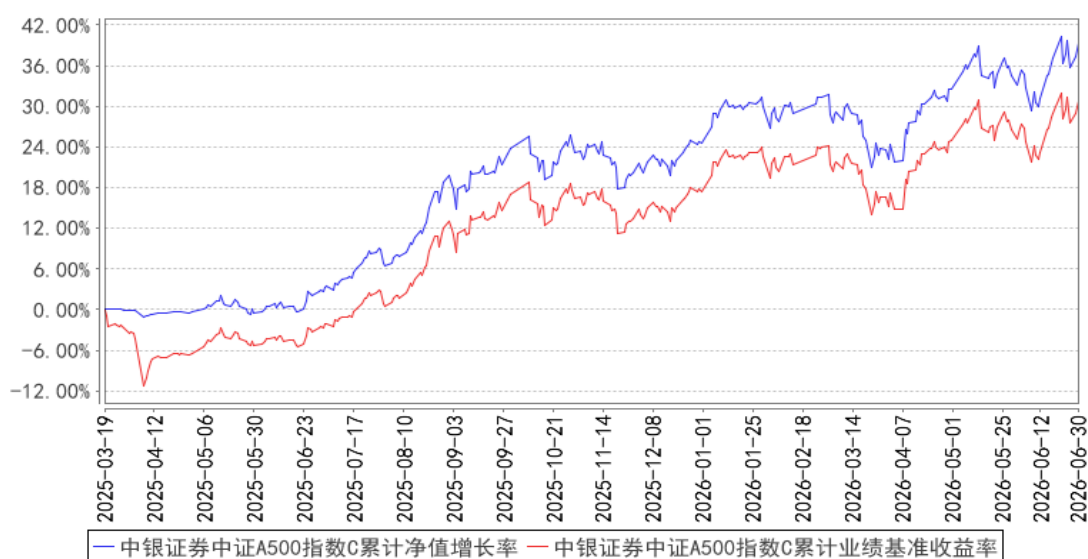
注：业绩比较基准=中证 A500 指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%。

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；自基金成立日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

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 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	2025 年 3 月 19 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《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，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。

报告期内，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，公司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 A500 指数的表现为 11.91%，高于沪深 300、万得全 A，低于中证 500 指数。报告期内对指数涨幅正贡献最大的三大成分行业为电子、通信、电力设备及新能源，负贡献最大的三大成分行业为纺织服装、商贸零售、轻工制造。截至 6 月底，中证 A500 指数滚动市盈率 17.93 倍，处于过去五年 93.95% 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、有色金属、汽车、计算机、建材等行业的占比小幅提升，通信、基础化工、机械、煤炭、食品饮料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

截至本报告期末中银证券中证 A500 指数 A 基金份额净值为 1.3970 元，本报告期基金份额净值增长率为 12.01%；同期业绩比较基准收益率为 11.34%。截至本报告期末中银证券中证 A500 指数 C 基金份额净值为 1.3930 元，本报告期基金份额净值增长率为 11.90%；同期业绩比较基准收益率为 11.34%。

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 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

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合规守信、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。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

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：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	716,611.52	2,920,251.48
结算备付金		22,993.15	48,252.45
存出保证金		32,237.63	33,675.91
交易性金融资产	6.4.7.2	65,998,975.07	45,916,433.27
其中：股票投资		62,674,761.69	45,916,433.27
基金投资		-	-
债券投资		3,324,213.38	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-

应收股利		-	-
应收申购款		136,030.33	43,530.13
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		66,906,847.70	48,962,143.24
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		129.08	-
应付赎回款		256,279.33	254,991.12
应付管理人报酬		7,885.77	6,272.43
应付托管费		2,628.58	2,090.82
应付销售服务费		1,644.19	1,021.62
应付投资顾问费		-	-
应交税费		101.14	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	39,266.85	133,422.04
负债合计		307,934.94	397,798.03
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	47,693,973.82	38,948,338.05
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	18,904,938.94	9,616,007.16
净资产合计		66,598,912.76	48,564,345.21
负债和净资产总计		66,906,847.70	48,962,143.24

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 47,693,973.82 份，其中中银证券中证 A500 指数 A 基金份额总额 40,501,000.68 份，基金份额净值 1.3970 元；中银证券中证 A500 指数 C 基金份额总额 7,192,973.14 份，基金份额净值 1.3930 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：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 3 月 19 日（基金 合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		7,446,495.46	4,579,895.21

1. 利息收入		8,488.09	372,925.26
其中：存款利息收入	6.4.7.13	8,488.09	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）		5,500,511.12	1,733,109.70
其中：股票投资收益	6.4.7.14	4,990,079.82	603,909.68
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	15,403.54	55,010.93
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	495,027.76	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	1,929,875.16	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	7,621.09	9,237.14
减：二、营业总支出		112,992.31	179,886.18
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	49,123.48	87,136.81
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	16,374.47	29,045.56
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	10,831.63	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		41.00	730.24
8. 其他费用	6.4.7.23	36,621.73	48,512.88
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,333,503.15	4,400,009.03
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,333,503.15	4,400,009.03
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		7,333,503.15	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：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	38,948,338.05	-	9,616,007.16	48,564,345.21
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	38,948,338.05	-	9,616,007.16	48,564,345.21
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	8,745,635.77	-	9,288,931.78	18,034,567.55
（一）、综合收益总额	-	-	7,333,503.15	7,333,503.15
（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）	8,745,635.77	-	1,955,428.63	10,701,064.40
其中：1. 基金申购款	59,586,396.94	-	18,382,412.71	77,968,809.65
2. 基金赎回款	-50,840,761.17	-	-16,426,984.08	-67,267,745.25
（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	47,693,973.82	-	18,904,938.94	66,598,912.76
项目	上年度可比期间 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：

<u>周冰</u>	<u>沈锋</u>	<u>金坚</u>
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 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。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,业经会计师事务所验证。本基金的基金管理人为中银国际证券股份有限公司(以下简称“中银证券”),基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司(以下简称“中国邮政储蓄银行”)。

根据《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,本基金根据认购费、申购费、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,在赎回时收取赎回费,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,但赎回时收取赎回费,并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、C 类两种收费模式并存,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)。本基金可以在履行适当程序后,参与融资和转融通证券出借业务。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%。

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的要求，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	716,611.52
等于：本金	716,366.55
加：应计利息	244.97
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	716,611.52

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		53,578,303.80	-	62,674,761.69	9,096,457.89
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	3,303,648.00	19,243.38	3,324,213.38	1,322.00
	银行间市场	-	-	-	-

	合计	3,303,648.00	19,243.38	3,324,213.38	1,322.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		56,881,951.80	19,243.38	65,998,975.07	9,097,779.89

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 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	2,645.12
其中：交易所市场	2,645.12
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	36,621.73
合计	39,266.85

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 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	33,740,612.69	33,740,612.69
本期申购	44,653,924.09	44,653,924.09
本期赎回（以“-”号填列）	-37,893,536.10	-37,893,536.10
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	40,501,000.68	40,501,000.68

中银证券中证 A500 指数 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,207,725.36	5,207,725.36
本期申购	14,932,472.85	14,932,472.85

本期赎回（以“-”号填列）	-12,947,225.07	-12,947,225.07
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	7,192,973.14	7,192,973.14

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
上年度末	4,969,802.00	3,370,889.63	8,340,691.63
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	4,969,802.00	3,370,889.63	8,340,691.63
本期利润	4,547,662.58	1,656,321.59	6,203,984.17
本期基金份额交易产生的变动数	958,315.65	574,903.95	1,533,219.60
其中：基金申购款	8,302,965.23	5,465,179.84	13,768,145.07
基金赎回款	-7,344,649.58	-4,890,275.89	-12,234,925.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,475,780.23	5,602,115.17	16,077,895.40

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
上年度末	755,549.44	519,766.09	1,275,315.53
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	755,549.44	519,766.09	1,275,315.53
本期利润	855,965.41	273,553.57	1,129,518.98
本期基金份额交易产生的变动数	221,979.61	200,229.42	422,209.03
其中：基金申购款	2,741,244.50	1,873,023.14	4,614,267.64
基金赎回款	-2,519,264.89	-1,672,793.72	-4,192,058.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,833,494.46	993,549.08	2,827,043.54

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	8,324.00
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	115.25
其他	48.84
合计	8,488.09

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	4,990,079.82
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	4,990,079.82

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	39,492,488.80
减：卖出股票成本总额	34,459,568.17
减：交易费用	42,840.81
买卖股票差价收入	4,990,079.82

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 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	16,293.54
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-890.00
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	15,403.54

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,023,515.23
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,001,450.00
减：应计利息总额	22,955.23
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-890.00

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	495,027.76
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	495,027.76

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	1,929,875.16
股票投资	1,928,553.16
债券投资	1,322.00
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	1,929,875.16

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	7,621.09
合计	7,621.09

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，将全额归入基金资产。

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，其中将转出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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	11,826.54
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-
合计	36,621.73

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、注册登记机构、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
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
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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 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（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）
中银证券	88,781,832.23	100.00	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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 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（%）	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例（%）
中银证券	7,202,658.00	100.00	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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 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（%）	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	17,395.30	100.00	2,645.12	100.00
关联方名称	上年度可比期间 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 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	49,123.48	87,136.81
其中：应支付销售机构的客户维护费	15,158.04	37,802.12
应支付基金管理人的净管理费	33,965.44	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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 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	16,374.47	29,045.56

注：支付基金托管人邮储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

	本期
--	----

获得销售服务费的各关联方名称	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中银证券中证 A500 指数 A	中银证券中证 A500 指数 C	合计
邮储银行	-	465.38	465.38
中国银行	-	4,106.09	4,106.09
中银证券	-	3,819.06	3,819.06
合计	-	8,390.53	8,390.53
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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

注：于本基金本报告期末及上年度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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 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	期末余额	当期利息收入
邮储银行	716,611.52	8,324.00	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上港集团（600018.SH）、邮储银行（601658.SH）和中国银行（601988.SH）。

于本报告期末，本基金持有上港集团 5,800 股，占基金净值比例 0.04%；持有邮储银行 20,800 股，占基金净值比例 0.15%；持有中国银行 27,100 股，占基金净值比例 0.23%（于上年度末，本基金持有上港集团 4,500 股，占基金净值比例 0.05%；持有邮储银行 17,600 股，占基金净值比例 0.20%；持有中国银行 22,800 股，占基金净值比例 0.27%）。

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	2026 年 6 月 25	1 个月（含）	新债未上市	100.00	100.00	30	3,000.00	3,000.04	-

	债	日								
--	---	---	--	--	--	--	--	--	--	--

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	832.00	2026 年 7 月 13 日	890.99	400	105,930.00	332,800.00	-

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 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、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台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。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	3,321,213.34	-
合计	3,321,213.34	-

注：未评级部分包括国债。本基金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	3,000.04	-
未评级	-	-
合计	3,000.04	-

注：本基金上年度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 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，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 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	716,611.52	-	-	-	716,611.52
结算备付金	22,993.15	-	-	-	22,993.15
存出保证金	32,237.63	-	-	-	32,237.63
交易性金融资产	3,324,213.38	-	-	62,674,761.69	65,998,975.07
应收申购款	-	-	-	136,030.33	136,030.33
资产总计	4,096,055.68	-	-	62,810,792.02	66,906,847.70
负债					
应付赎回款	-	-	-	256,279.33	256,279.33
应付管理人报酬	-	-	-	7,885.77	7,885.77
应付托管费	-	-	-	2,628.58	2,628.58
应付清算款	-	-	-	129.08	129.08
应付销售服务费	-	-	-	1,644.19	1,644.19
应交税费	-	-	-	101.14	101.14
其他负债	-	-	-	39,266.85	39,266.85
负债总计	-	-	-	307,934.94	307,934.94
利率敏感度缺口	4,096,055.68	-	-	62,502,857.08	66,598,912.76
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,920,251.48	-	-	-	2,920,251.48
结算备付金	48,252.45	-	-	-	48,252.45
存出保证金	33,675.91	-	-	-	33,675.91
交易性金融资产	-	-	-	45,916,433.27	45,916,433.27
应收申购款	-	-	-	43,530.13	43,530.13
资产总计	3,002,179.84	-	-	45,959,963.40	48,962,143.24
负债					
应付赎回款	-	-	-	254,991.12	254,991.12
应付管理人报酬	-	-	-	6,272.43	6,272.43
应付托管费	-	-	-	2,090.82	2,090.82
应付销售服务费	-	-	-	1,021.62	1,021.62
其他负债	-	-	-	133,422.04	133,422.04
负债总计	-	-	-	397,798.03	397,798.03
利率敏感度缺口	3,002,179.84	-	-	45,562,165.37	48,564,345.21

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 4.99%（2025 年 12 月 31 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（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 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	62,674,761.69	94.11	45,916,433.27	94.55
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	62,674,761.69	94.11	45,916,433.27	94.55

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%	3,299,006.07	1,666,207.82
	业绩比较基准下降 5%	-3,299,006.07	-1,666,207.82

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	62,341,961.69	45,638,838.27
第二层次	3,657,013.38	277,595.00
第三层次	-	-
合计	65,998,975.07	45,916,433.27

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	62,674,761.69	93.67

	其中：股票	62,674,761.69	93.67
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,324,213.38	4.97
	其中：债券	3,324,213.38	4.97
	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	739,604.67	1.11
8	其他各项资产	168,267.96	0.25
9	合计	66,906,847.70	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	198,536.00	0.30
B	采矿业	2,576,300.96	3.87
C	制造业	44,283,111.33	66.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,369,579.00	2.06
E	建筑业	766,715.00	1.15
F	批发和零售业	479,457.00	0.72
G	交通运输、仓储和邮政业	1,396,155.00	2.10
H	住宿和餐饮业	30,387.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,513,366.80	5.28
J	金融业	6,093,881.00	9.15
K	房地产业	352,636.00	0.53
L	租赁和商务服务业	450,705.80	0.68
M	科学研究和技术服务业	750,046.00	1.13
N	水利、环境和公共设施管理业	107,920.80	0.16
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	20,700.00	0.03
Q	卫生和社会工作	124,022.00	0.19

R	文化、体育和娱乐业	48,482.00	0.07
S	综合	112,760.00	0.17
	合计	62,674,761.69	94.11

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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	300308	中际旭创	2,100	2,667,000.00	4.00
2	300750	宁德时代	5,000	1,965,050.00	2.95
3	300502	新易盛	2,644	1,604,908.00	2.41
4	600519	贵州茅台	1,200	1,422,588.00	2.14
5	603986	兆易创新	1,300	1,059,500.00	1.59
6	601318	中国平安	20,200	964,348.00	1.45
7	688256	寒武纪	596	950,947.80	1.43
8	600036	招商银行	23,400	830,700.00	1.25
9	601899	紫金矿业	31,164	783,462.96	1.18
10	002371	北方华创	850	751,876.00	1.13
11	002475	立讯精密	9,700	682,880.00	1.03
12	000333	美的集团	8,800	664,664.00	1.00
13	688008	澜起科技	2,090	647,691.00	0.97
14	002384	东山精密	2,400	629,640.00	0.95
15	688012	中微公司	1,341	628,258.50	0.94
16	688041	海光信息	1,680	622,104.00	0.93
17	600900	长江电力	23,200	614,104.00	0.92
18	688981	中芯国际	3,770	598,751.40	0.90
19	000725	京东方 A	68,800	597,184.00	0.90
20	603259	药明康德	4,700	585,197.00	0.88
21	601166	兴业银行	32,100	531,576.00	0.80
22	600030	中信证券	18,500	531,505.00	0.80
23	300059	东方财富	24,000	489,120.00	0.73
24	600183	生益科技	2,800	485,520.00	0.73
25	600276	恒瑞医药	8,500	442,340.00	0.66
26	601398	工商银行	61,200	432,684.00	0.65
27	300274	阳光电源	2,700	429,354.00	0.64

28	300408	三环集团	2,500	417,250.00	0.63
29	300476	胜宏科技	1,200	415,716.00	0.62
30	002594	比亚迪	5,100	406,470.00	0.61
31	600487	亨通光电	3,700	404,558.00	0.61
32	601211	国泰海通	21,400	389,480.00	0.58
33	002463	沪电股份	2,500	382,000.00	0.57
34	688498	源杰科技	200	377,200.00	0.57
35	300394	天孚通信	1,216	368,058.88	0.55
36	301308	江波龙	500	351,900.00	0.53
37	000988	华工科技	1,879	346,882.19	0.52
38	688525	佰维存储	700	346,311.00	0.52
39	688072	拓荆科技	400	332,800.00	0.50
40	601288	农业银行	54,400	330,208.00	0.50
41	600176	中国巨石	4,500	327,960.00	0.49
42	601328	交通银行	50,600	325,358.00	0.49
43	000651	格力电器	8,500	318,750.00	0.48
44	600522	中天科技	5,200	315,536.00	0.47
45	603019	中科曙光	2,800	300,244.00	0.45
46	688521	芯原股份	800	296,912.00	0.45
47	600150	XD 中国船	8,600	290,594.00	0.44
48	603993	洛阳钼业	16,500	289,575.00	0.43
49	600887	伊利股份	12,000	287,520.00	0.43
50	600584	长电科技	2,700	279,585.00	0.42
51	000338	潍柴动力	10,200	277,950.00	0.42
52	000858	五 粮 液	3,700	273,800.00	0.41
53	300604	长川科技	800	273,136.00	0.41
54	688347	华虹宏力	800	269,040.00	0.40
55	601816	京沪高铁	55,500	251,415.00	0.38
56	600309	万华化学	3,600	246,276.00	0.37
57	002008	大族激光	1,600	240,176.00	0.36
58	300124	汇川技术	3,600	238,788.00	0.36
59	002415	海康威视	6,900	235,980.00	0.35
60	002281	光迅科技	900	231,246.00	0.35
61	600111	北方稀土	4,800	230,640.00	0.35
62	002916	深南电路	500	228,950.00	0.34
63	000100	TCL 科技	39,300	228,726.00	0.34
64	688120	华海清科	692	222,948.56	0.33
65	000063	中兴通讯	6,100	220,759.00	0.33
66	600000	浦发银行	25,200	216,972.00	0.33
67	600089	特变电工	9,600	216,000.00	0.32
68	300136	信维通信	1,800	214,650.00	0.32
69	601857	中国石油	24,500	212,660.00	0.32
70	002028	思源电气	1,200	207,600.00	0.31

71	300857	协创数据	600	203,940.00	0.31
72	300433	蓝思科技	3,800	203,908.00	0.31
73	601088	中国神华	5,200	203,008.00	0.30
74	600031	三一重工	11,200	193,536.00	0.29
75	300014	亿纬锂能	2,900	188,587.00	0.28
76	601601	中国太保	6,500	185,380.00	0.28
77	000001	平安银行	18,400	184,920.00	0.28
78	002050	三花智控	4,200	184,086.00	0.28
79	002353	杰瑞股份	1,200	183,000.00	0.27
80	002714	牧原股份	5,200	181,948.00	0.27
81	000792	盐湖股份	6,000	181,140.00	0.27
82	300475	香农芯创	600	180,000.00	0.27
83	600549	厦门钨业	2,100	178,920.00	0.27
84	002156	通富微电	2,300	174,501.00	0.26
85	300223	北京君正	700	174,230.00	0.26
86	600406	国电南瑞	7,600	173,660.00	0.26
87	601668	中国建筑	39,100	169,694.00	0.25
88	002436	兴森科技	3,200	163,040.00	0.24
89	000657	中钨高新	1,700	162,724.00	0.24
90	002602	世纪华通	11,200	157,920.00	0.24
91	601919	中远海控	11,900	157,794.00	0.24
92	601988	中国银行	27,100	155,012.00	0.23
93	601728	中国电信	29,400	152,586.00	0.23
94	603501	豪威集团	1,600	151,760.00	0.23
95	600660	福耀玻璃	3,000	151,320.00	0.23
96	601012	隆基绿能	11,500	150,880.00	0.23
97	300760	迈瑞医疗	1,100	149,413.00	0.22
98	601225	陕西煤业	7,300	148,555.00	0.22
99	300054	鼎龙股份	1,400	148,358.00	0.22
100	002230	科大讯飞	3,600	147,024.00	0.22
101	600941	中国移动	1,700	146,421.00	0.22
102	600690	海尔智家	7,100	144,911.00	0.22
103	300033	同花顺	600	144,600.00	0.22
104	601985	中国核电	15,600	140,868.00	0.21
105	002352	顺丰控股	4,500	140,670.00	0.21
106	603799	华友钴业	2,900	139,954.00	0.21
107	002709	天赐材料	2,700	138,861.00	0.21
108	600160	巨化股份	2,600	137,826.00	0.21
109	002460	赣锋锂业	2,100	137,340.00	0.21
110	002938	鹏鼎控股	1,300	136,994.00	0.21
111	002851	麦格米特	800	133,744.00	0.20
112	000977	浪潮信息	1,900	133,000.00	0.20
113	300442	润泽科技	1,600	132,912.00	0.20

114	688777	中控技术	1,130	132,775.00	0.20
115	300567	精测电子	400	127,040.00	0.19
116	000425	徐工机械	15,500	125,395.00	0.19
117	688126	沪硅产业	3,120	124,456.80	0.19
118	002202	金风科技	5,200	124,280.00	0.19
119	300346	南大光电	1,340	124,151.00	0.19
120	000938	紫光股份	4,300	124,098.00	0.19
121	300757	罗博特科	200	123,800.00	0.19
122	688002	睿创微纳	800	123,752.00	0.19
123	601600	中国铝业	15,000	123,300.00	0.19
124	600028	中国石化	27,600	123,096.00	0.18
125	002466	天齐锂业	2,000	122,640.00	0.18
126	600938	中国海油	4,500	122,175.00	0.18
127	300661	圣邦股份	850	121,958.00	0.18
128	600460	XD 士兰微	2,200	120,252.00	0.18
129	002600	领益智造	6,900	119,646.00	0.18
130	601766	中国中车	23,000	119,600.00	0.18
131	600050	中国联通	29,500	118,000.00	0.18
132	002080	中材科技	1,300	117,000.00	0.18
133	002049	紫光国微	1,300	115,375.00	0.17
134	002837	英维克	1,430	113,770.80	0.17
135	601628	中国人寿	3,200	113,120.00	0.17
136	002185	华天科技	5,000	111,550.00	0.17
137	002179	中航光电	2,400	110,880.00	0.17
138	002407	多氟多	2,200	110,506.00	0.17
139	002138	顺络电子	1,500	109,650.00	0.16
140	000568	泸州老窖	1,400	108,528.00	0.16
141	601100	恒立液压	1,000	107,560.00	0.16
142	601872	招商轮船	6,100	107,177.00	0.16
143	300395	菲利华	800	106,984.00	0.16
144	688111	金山办公	500	106,525.00	0.16
145	600879	航天电子	5,000	106,450.00	0.16
146	603288	海天味业	3,200	106,112.00	0.16
147	002241	歌尔股份	4,700	105,891.00	0.16
148	601006	大秦铁路	22,600	104,186.00	0.16
149	000408	藏格矿业	1,500	103,980.00	0.16
150	300390	天华新能	1,100	102,861.00	0.15
151	601658	邮储银行	20,800	102,544.00	0.15
152	688271	XD 联影医	1,000	101,230.00	0.15
153	688396	华润微	1,037	101,159.35	0.15
154	605117	德业股份	952	101,083.36	0.15
155	688469	芯联集成	9,500	100,795.00	0.15
156	600905	三峡能源	27,100	100,541.00	0.15

157	002625	光启技术	3,300	100,056.00	0.15
158	600489	中金黄金	5,500	99,275.00	0.15
159	601888	中国中免	1,800	96,678.00	0.15
160	000630	铜陵有色	15,200	96,672.00	0.15
161	600893	航发动力	2,500	95,850.00	0.14
162	600010	包钢股份	42,900	95,667.00	0.14
163	600673	东阳光	2,800	94,024.00	0.14
164	300058	蓝色光标	6,780	93,292.80	0.14
165	300037	新宙邦	1,000	92,850.00	0.14
166	002027	分众传媒	19,100	92,444.00	0.14
167	002273	水晶光电	2,600	92,248.00	0.14
168	601127	赛力斯	1,500	91,875.00	0.14
169	600760	中航沈飞	2,200	90,420.00	0.14
170	601689	拓普集团	1,600	90,272.00	0.14
171	600118	中国卫星	1,100	90,255.00	0.14
172	600019	宝钢股份	16,500	89,595.00	0.13
173	000426	兴业银锡	2,700	88,992.00	0.13
174	600362	江西铜业	2,000	86,600.00	0.13
175	000807	云铝股份	3,900	86,346.00	0.13
176	300450	先导智能	2,100	85,512.00	0.13
177	600989	宝丰能源	4,200	85,386.00	0.13
178	600104	上汽集团	8,706	84,970.56	0.13
179	300751	迈为股份	300	84,738.00	0.13
180	600988	赤峰黄金	3,200	84,224.00	0.13
181	601168	西部矿业	3,100	84,134.00	0.13
182	601727	上海电气	12,000	84,000.00	0.13
183	688017	绿的谐波	200	83,572.00	0.13
184	600875	东方电气	2,900	83,433.00	0.13
185	605589	圣泉集团	1,300	82,641.00	0.12
186	002738	中矿资源	1,400	82,586.00	0.12
187	002001	新 和 成	2,900	82,418.00	0.12
188	600885	宏发股份	2,380	82,086.20	0.12
189	600667	太极实业	2,800	81,704.00	0.12
190	000960	锡业股份	1,900	81,111.00	0.12
191	601390	中国中铁	19,400	80,898.00	0.12
192	002422	科伦药业	2,100	80,892.00	0.12
193	000538	云南白药	1,700	80,529.00	0.12
194	600392	盛和资源	2,700	80,379.00	0.12
195	002126	银轮股份	1,600	79,680.00	0.12
196	600795	国电电力	16,900	78,923.00	0.12
197	600547	山东黄金	3,400	78,506.00	0.12
198	600585	海螺水泥	4,600	77,970.00	0.12
199	000831	中国稀土	1,400	77,686.00	0.12

200	600418	江淮汽车	3,000	77,490.00	0.12
201	300782	卓胜微	700	76,706.00	0.12
202	601669	中国电建	16,300	76,610.00	0.12
203	301358	湖南裕能	1,000	75,870.00	0.11
204	002648	卫星化学	3,200	75,168.00	0.11
205	600141	兴发集团	1,600	75,152.00	0.11
206	002812	恩捷股份	1,100	73,601.00	0.11
207	300015	爱尔眼科	8,900	73,514.00	0.11
208	002129	TCL 中环	6,100	73,322.00	0.11
209	600096	云天化	2,400	72,960.00	0.11
210	300316	晶盛机电	1,200	72,480.00	0.11
211	688099	晶晨股份	700	72,030.00	0.11
212	601179	中国西电	4,800	71,616.00	0.11
213	600346	恒力石化	4,000	70,840.00	0.11
214	601868	中国能建	26,500	70,755.00	0.11
215	002195	岩山科技	10,700	69,978.00	0.11
216	600580	卧龙电驱	2,100	69,510.00	0.10
217	600497	驰宏锌锗	5,700	69,027.00	0.10
218	002558	巨人网络	2,500	68,900.00	0.10
219	600482	中国动力	2,100	68,880.00	0.10
220	300418	昆仑万维	1,700	68,612.00	0.10
221	000066	中国长城	3,600	68,580.00	0.10
222	000625	长安汽车	9,400	67,398.00	0.10
223	600895	张江高科	1,800	67,050.00	0.10
224	600066	宇通客车	2,500	67,025.00	0.10
225	600426	华鲁恒升	2,800	66,976.00	0.10
226	600157	永泰能源	41,500	66,815.00	0.10
227	600221	海航控股	48,800	65,880.00	0.10
228	600436	片仔癀	600	65,568.00	0.10
229	688578	艾力斯	600	65,520.00	0.10
230	000157	中联重科	9,400	65,518.00	0.10
231	002532	天山铝业	6,100	65,453.00	0.10
232	002821	凯莱英	400	64,800.00	0.10
233	688213	思特威	600	64,242.00	0.10
234	605499	东鹏饮料	520	64,183.60	0.10
235	300803	指南针	700	64,169.00	0.10
236	002340	格林美	9,700	64,117.00	0.10
237	600011	华能国际	8,400	63,756.00	0.10
238	600711	盛屯矿业	5,800	63,626.00	0.10
239	000933	神火股份	3,000	63,600.00	0.10
240	600048	保利发展	13,600	62,968.00	0.09
241	600143	金发科技	4,000	61,800.00	0.09
242	600438	通威股份	5,100	61,761.00	0.09

243	600570	恒生电子	2,900	61,451.00	0.09
244	600115	中国东航	16,100	61,341.00	0.09
245	002493	荣盛石化	5,700	61,275.00	0.09
246	300017	网宿科技	4,700	61,147.00	0.09
247	002236	大华股份	3,700	61,013.00	0.09
248	002131	利欧股份	12,800	60,800.00	0.09
249	688036	传音控股	1,022	60,246.90	0.09
250	600886	国投电力	4,500	59,895.00	0.09
251	002456	欧菲光	6,300	59,598.00	0.09
252	600352	浙江龙盛	4,900	59,339.00	0.09
253	688506	百利天恒	200	58,806.00	0.09
254	601233	桐昆股份	2,700	58,455.00	0.09
255	003816	中国广核	14,900	58,259.00	0.09
256	300438	鹏辉能源	700	57,995.00	0.09
257	603659	璞泰来	2,000	57,860.00	0.09
258	300339	润和软件	1,500	57,765.00	0.09
259	601058	赛轮轮胎	5,000	57,650.00	0.09
260	601360	三六零	6,600	57,354.00	0.09
261	000301	东方盛虹	5,000	57,250.00	0.09
262	600026	中远海能	3,100	55,614.00	0.08
263	600009	上海机场	2,400	55,440.00	0.08
264	002074	国轩高科	2,000	55,020.00	0.08
265	300759	康龙化成	1,900	54,967.00	0.08
266	688235	百济神州	215	54,741.15	0.08
267	002555	三七互娱	2,900	54,723.00	0.08
268	002472	双环传动	1,300	53,963.00	0.08
269	600196	复星医药	2,400	53,928.00	0.08
270	000768	中航西飞	2,600	53,248.00	0.08
271	601111	中国国航	8,800	53,240.00	0.08
272	300207	欣旺达	2,800	53,172.00	0.08
273	300001	特锐德	1,400	52,962.00	0.08
274	600029	南方航空	10,200	52,836.00	0.08
275	600415	小商品城	5,200	52,832.00	0.08
276	002601	龙佰集团	3,200	52,736.00	0.08
277	000975	山金国际	3,100	52,700.00	0.08
278	600674	川投能源	3,700	52,429.00	0.08
279	002517	恺英网络	3,200	52,000.00	0.08
280	600219	南山铝业	13,000	51,870.00	0.08
281	601186	中国铁建	8,700	51,765.00	0.08
282	300458	全志科技	1,300	51,298.00	0.08
283	603129	春风动力	200	51,160.00	0.08
284	301236	软通动力	1,200	50,940.00	0.08
285	002128	电投能源	2,200	50,864.00	0.08

286	601117	中国化学	6,900	50,715.00	0.08
287	600233	圆通速递	3,200	50,400.00	0.08
288	300115	长盈精密	1,800	50,292.00	0.08
289	688122	西部超导	800	50,248.00	0.08
290	601877	正泰电器	2,000	50,140.00	0.08
291	002155	湖南黄金	2,100	50,127.00	0.08
292	600372	中航机载	4,600	49,910.00	0.07
293	002595	豪迈科技	1,060	49,396.00	0.07
294	603650	彤程新材	500	48,990.00	0.07
295	002920	德赛西威	600	48,900.00	0.07
296	600839	四川长虹	7,000	48,860.00	0.07
297	002465	海格通信	3,800	48,526.00	0.07
298	300454	深信服	500	48,100.00	0.07
299	300347	泰格医药	1,000	48,000.00	0.07
300	000963	华东医药	1,700	47,804.00	0.07
301	300568	星源材质	2,500	46,800.00	0.07
302	688266	泽璟制药	400	46,664.00	0.07
303	600741	华域汽车	3,000	46,560.00	0.07
304	688047	龙芯中科	300	46,401.00	0.07
305	300024	机器人	2,400	46,392.00	0.07
306	000547	航天发展	2,400	45,960.00	0.07
307	002130	沃尔核材	2,400	45,504.00	0.07
308	300763	锦浪科技	500	45,175.00	0.07
309	002497	雅化集团	2,200	44,814.00	0.07
310	000878	云南铜业	2,800	44,464.00	0.07
311	300012	华测检测	3,200	44,352.00	0.07
312	001979	招商蛇口	6,800	43,724.00	0.07
313	300083	创世纪	3,200	43,584.00	0.07
314	002444	巨星科技	1,400	43,540.00	0.07
315	688390	固德威	400	43,404.00	0.07
316	300496	中科创达	700	43,253.00	0.06
317	000034	神州数码	1,540	42,735.00	0.06
318	002271	东方雨虹	3,600	42,732.00	0.06
319	002414	高德红外	3,200	42,432.00	0.06
320	002432	九安医疗	600	42,408.00	0.06
321	300474	景嘉微	700	42,336.00	0.06
322	300866	安克创新	400	41,800.00	0.06
323	603979	金诚信	700	41,321.00	0.06
324	600699	均胜电子	1,900	41,059.00	0.06
325	601021	春秋航空	900	41,022.00	0.06
326	000423	东阿阿胶	900	40,824.00	0.06
327	601319	中国人保	6,000	40,560.00	0.06
328	300748	金力永磁	1,300	40,105.00	0.06

329	002078	太阳纸业	3,200	39,968.00	0.06
330	000661	长春高新	600	39,960.00	0.06
331	603606	东方电缆	960	39,849.60	0.06
332	603087	甘李药业	700	39,732.00	0.06
333	000733	振华科技	700	39,648.00	0.06
334	002756	永兴材料	700	39,648.00	0.06
335	300919	中伟新材	900	39,375.00	0.06
336	601615	明阳智能	3,400	39,338.00	0.06
337	688331	荣昌生物	300	39,078.00	0.06
338	300142	沃森生物	3,000	38,970.00	0.06
339	601800	中国交建	6,800	38,828.00	0.06
340	000002	万 科 A	13,000	38,480.00	0.06
341	300073	当升科技	800	38,432.00	0.06
342	600039	四川路桥	4,900	38,318.00	0.06
343	002252	上海莱士	8,800	38,192.00	0.06
344	601677	明泰铝业	2,300	38,180.00	0.06
345	300432	富临精工	1,900	38,171.00	0.06
346	002025	航天电器	500	38,110.00	0.06
347	688676	金盘科技	446	37,749.44	0.06
348	600226	亨通股份	3,900	37,401.00	0.06
349	688599	天合光能	2,620	36,994.40	0.06
350	688223	晶科能源	7,710	36,622.50	0.05
351	688617	惠泰医疗	200	36,312.00	0.05
352	600588	用友网络	3,900	35,802.00	0.05
353	001965	招商公路	3,900	35,724.00	0.05
354	002831	裕同科技	1,000	35,560.00	0.05
355	300724	捷佳伟创	500	35,300.00	0.05
356	300677	英科医疗	900	35,253.00	0.05
357	002064	华峰化学	3,700	35,113.00	0.05
358	002294	信立泰	1,100	35,079.00	0.05
359	302132	中航成飞	600	34,992.00	0.05
360	601633	长城汽车	2,300	34,707.00	0.05
361	300972	万辰集团	200	34,682.00	0.05
362	000786	北新建材	1,900	34,371.00	0.05
363	688180	君实生物	1,000	33,820.00	0.05
364	000519	中兵红箭	1,600	33,712.00	0.05
365	603806	福斯特	2,000	33,580.00	0.05
366	688608	恒玄科技	200	33,438.00	0.05
367	600516	方大炭素	5,400	33,318.00	0.05
368	601618	中国中冶	13,600	33,184.00	0.05
369	600177	雅戈尔	4,400	33,132.00	0.05
370	002176	江特电机	3,300	33,033.00	0.05
371	300558	贝达药业	500	32,535.00	0.05

372	601607	上海医药	2,100	32,340.00	0.05
373	000623	吉林敖东	1,800	31,914.00	0.05
374	000617	中油资本	4,800	31,632.00	0.05
375	300699	光威复材	1,100	31,515.00	0.05
376	002318	久立特材	1,300	31,070.00	0.05
377	002085	万丰奥威	2,800	31,052.00	0.05
378	300251	光线传媒	2,800	31,052.00	0.05
379	603260	合盛硅业	640	30,886.40	0.05
380	002459	晶澳科技	3,800	30,780.00	0.05
381	002065	东华软件	4,300	30,702.00	0.05
382	603596	伯特利	1,232	30,602.88	0.05
383	688169	石头科技	320	30,390.40	0.05
384	002266	浙富控股	6,000	30,360.00	0.05
385	600499	科达制造	2,200	30,360.00	0.05
386	688472	阿特斯	2,800	30,296.00	0.05
387	688005	容百科技	990	30,294.00	0.05
388	002044	美年健康	6,000	30,180.00	0.05
389	600085	同仁堂	1,300	30,043.00	0.05
390	603605	珀莱雅	500	29,960.00	0.04
391	000032	深桑达 A	1,200	29,940.00	0.04
392	300409	道氏技术	1,500	29,895.00	0.04
393	688188	柏楚电子	280	29,876.00	0.04
394	605090	九丰能源	800	29,736.00	0.04
395	300003	乐普医疗	2,500	29,625.00	0.04
396	600515	海南机场	10,800	29,592.00	0.04
397	300832	新产业	700	29,400.00	0.04
398	002405	四维图新	4,500	29,115.00	0.04
399	600862	中航高科	1,600	28,848.00	0.04
400	000683	博源化工	5,000	28,800.00	0.04
401	600521	华海药业	2,000	28,800.00	0.04
402	688065	凯赛生物	600	28,710.00	0.04
403	601216	君正集团	6,400	28,544.00	0.04
404	000415	渤海租赁	7,000	28,490.00	0.04
405	600803	新奥股份	1,800	28,440.00	0.04
406	000039	中集集团	3,500	28,385.00	0.04
407	002223	鱼跃医疗	1,100	28,226.00	0.04
408	000400	许继电气	1,300	28,210.00	0.04
409	300342	天银机电	600	28,200.00	0.04
410	600704	物产中大	5,900	27,848.00	0.04
411	603766	隆鑫通用	2,300	27,439.00	0.04
412	000999	华润三九	1,220	27,437.80	0.04
413	301550	斯菱智驱	300	27,429.00	0.04
414	600018	上港集团	5,800	27,376.00	0.04

415	601799	星宇股份	300	27,186.00	0.04
416	300122	智飞生物	2,300	26,887.00	0.04
417	000887	中鼎股份	1,500	26,835.00	0.04
418	600312	平高电气	1,500	26,490.00	0.04
419	000830	鲁西化工	2,200	26,400.00	0.04
420	000967	盈峰环境	2,500	26,325.00	0.04
421	600166	福田汽车	9,000	26,190.00	0.04
422	600153	建发股份	3,300	26,169.00	0.04
423	300896	爱美客	300	26,160.00	0.04
424	600332	白云山	1,300	26,052.00	0.04
425	600765	中航重机	2,000	25,840.00	0.04
426	002007	华兰生物	2,100	25,599.00	0.04
427	600486	扬农化工	500	25,350.00	0.04
428	002410	广联达	3,100	25,296.00	0.04
429	600323	瀚蓝环境	900	24,714.00	0.04
430	002603	以岭药业	1,600	24,000.00	0.04
431	603568	伟明环保	1,560	23,992.80	0.04
432	600529	山东药玻	1,300	23,985.00	0.04
433	601000	唐山港	5,700	23,655.00	0.04
434	600398	海澜之家	4,500	23,535.00	0.04
435	688009	中国通号	4,900	23,324.00	0.04
436	002389	航天彩虹	1,300	23,101.00	0.03
437	601018	宁波港	7,300	22,995.00	0.03
438	600208	衢州发展	8,100	22,923.00	0.03
439	688116	天奈科技	600	22,920.00	0.03
440	600008	首创环保	8,300	22,576.00	0.03
441	600998	九州通	4,800	22,512.00	0.03
442	600170	上海建工	10,100	22,422.00	0.03
443	600316	洪都航空	800	22,352.00	0.03
444	000932	华菱钢铁	6,400	22,208.00	0.03
445	600161	天坛生物	1,900	22,002.00	0.03
446	000738	航发控制	1,200	21,948.00	0.03
447	600820	隧道股份	4,200	21,882.00	0.03
448	603885	吉祥航空	2,100	21,609.00	0.03
449	688303	大全能源	1,230	21,438.90	0.03
450	601238	广汽集团	4,200	21,336.00	0.03
451	688063	派能科技	400	21,308.00	0.03
452	300118	东方日升	1,700	21,165.00	0.03
453	002607	中公教育	11,500	20,700.00	0.03
454	688114	华大智造	400	20,432.00	0.03
455	600763	通策医疗	600	20,328.00	0.03
456	603486	科沃斯	400	20,300.00	0.03
457	600038	中直股份	800	20,232.00	0.03

458	603816	顾家家居	900	20,124.00	0.03
459	603939	益丰药房	1,100	19,778.00	0.03
460	300049	福瑞医科	500	19,440.00	0.03
461	601567	三星电气	1,300	19,422.00	0.03
462	601880	辽港股份	14,000	19,320.00	0.03
463	603392	万泰生物	700	18,879.00	0.03
464	000833	粤桂股份	800	18,736.00	0.03
465	600535	天士力	1,400	18,522.00	0.03
466	300573	兴齐眼药	451	18,382.76	0.03
467	002244	滨江集团	2,400	18,240.00	0.03
468	600511	国药股份	700	18,228.00	0.03
469	600816	建元信托	7,400	18,056.00	0.03
470	002120	韵达股份	2,800	17,808.00	0.03
471	300676	华大基因	500	17,530.00	0.03
472	688166	博瑞医药	500	17,505.00	0.03
473	601155	新城控股	1,700	17,442.00	0.03
474	300144	宋城演艺	3,000	17,430.00	0.03
475	300100	双林股份	600	16,668.00	0.03
476	000998	隆平高科	2,200	16,588.00	0.02
477	600064	南京高科	2,300	16,399.00	0.02
478	002544	普天科技	900	16,398.00	0.02
479	600754	锦江酒店	900	16,191.00	0.02
480	601866	中远海发	7,300	16,133.00	0.02
481	600635	大众公用	3,700	15,836.00	0.02
482	000035	中国天楹	3,200	15,456.00	0.02
483	600655	豫园股份	3,700	15,207.00	0.02
484	300457	赢合科技	700	14,756.00	0.02
485	300601	康泰生物	1,300	14,742.00	0.02
486	600004	白云机场	2,000	14,520.00	0.02
487	603899	晨光股份	700	14,441.00	0.02
488	600258	首旅酒店	1,300	14,196.00	0.02
489	600663	陆家嘴	2,200	13,816.00	0.02
490	600859	王府井	1,500	13,770.00	0.02
491	002091	江苏国泰	1,900	13,737.00	0.02
492	300070	碧水源	4,200	13,398.00	0.02
493	000069	华侨城 A	7,500	12,300.00	0.02
494	600864	哈投股份	2,300	11,937.00	0.02
495	002292	奥飞娱乐	1,700	11,152.00	0.02
496	301078	孩子王	1,600	10,816.00	0.02
497	002891	中宠股份	400	10,688.00	0.02
498	600325	华发股份	4,200	9,702.00	0.01
499	603833	欧派家居	300	9,033.00	0.01
500	002572	索菲亚	1,100	8,030.00	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。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	1,519,276.00	3.13
2	600519	贵州茅台	1,220,820.03	2.51
3	300308	中际旭创	1,082,095.00	2.23
4	601318	中国平安	1,009,548.00	2.08
5	688256	寒武纪	932,776.00	1.92
6	601899	紫金矿业	918,951.00	1.89
7	600036	招商银行	704,856.00	1.45
8	300502	新易盛	683,143.00	1.41
9	000333	美的集团	539,583.00	1.11
10	600900	长江电力	483,730.00	1.00
11	601166	兴业银行	475,697.00	0.98
12	688008	澜起科技	438,957.44	0.90
13	002475	立讯精密	428,800.00	0.88
14	002371	北方华创	419,733.00	0.86
15	300059	东方财富	411,375.00	0.85
16	600030	中信证券	394,522.00	0.81
17	002594	比亚迪	367,858.00	0.76
18	600276	恒瑞医药	365,734.00	0.75
19	601398	工商银行	353,349.00	0.73
20	688041	海光信息	352,219.04	0.73

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	300750	宁德时代	1,353,219.00	2.79
2	300308	中际旭创	1,093,682.00	2.25
3	688256	寒武纪	1,060,518.05	2.18
4	600519	贵州茅台	947,785.00	1.95
5	601318	中国平安	774,472.00	1.59
6	601899	紫金矿业	691,031.00	1.42
7	300502	新易盛	640,364.00	1.32
8	600036	招商银行	563,792.00	1.16
9	000333	美的集团	476,546.00	0.98

10	688008	澜起科技	441,133.90	0.91
11	002475	立讯精密	393,550.00	0.81
12	600900	长江电力	390,618.00	0.80
13	601166	兴业银行	374,238.00	0.77
14	688041	海光信息	351,430.35	0.72
15	002371	北方华创	335,683.00	0.69
16	300059	东方财富	315,531.00	0.65
17	600030	中信证券	312,896.00	0.64
18	002594	比亚迪	303,366.00	0.62
19	601398	工商银行	287,349.00	0.59
20	600276	恒瑞医药	281,044.00	0.58

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	49,289,343.43
卖出股票收入（成交）总额	39,492,488.80

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	3,321,213.34	4.99
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）	3,000.04	0.00
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	3,324,213.38	4.99

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	019827	26 国债 01	10,000	1,006,481.92	1.51
2	019792	25 国债 19	8,000	808,393.86	1.21
3	102326	国债 2601	8,000	805,185.53	1.21
4	019835	26 国债 09	5,000	500,822.88	0.75

5	102334	国债 2609	2,000	200,329.15	0.30
---	--------	---------	-------	------------	------

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：
招商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的行政处罚。
本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。
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	32,237.63
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	136,030.33
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	168,267.96

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：无。

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	1,182	34,264.81	—	—	40,501,000.68	100.00
中银证券中证 A500 指数 C	419	17,167.00	—	—	7,192,973.14	100.00
合计	1,601	29,790.11	—	—	47,693,973.82	100.00

注：机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额），

户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

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	141,648.73	0.3497
	中银证券中证 A500 指数 C	88,174.77	1.2258
	合计	229,823.50	0.4819

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	0~10
	中银证券中证 A500 指数 C	—
	合计	0~10

§ 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
本报告期期初基金份额总额	33,740,612.69	5,207,725.36
本报告期基金总申购份额	44,653,924.09	14,932,472.85
减：本报告期基金总赎回份额	37,893,536.10	12,947,225.07
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	40,501,000.68	7,192,973.14

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 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相关从业人员受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人托管业务部门未受到调查或处罚。

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，本基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚。

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	2	88,781,832.23	100.00	17,395.30	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。

10.7.2 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 (%)
中银证券	7,202,658.00	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
2	中银证券中证 A500 指数型证券投资基金 2025 年第四季度报告	公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 1 月 22 日
3	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
4	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
5	中银证券中证 A500 指数型证券投资基金 2025 年年度报告	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
7	中银国际证券股份有限公司关于新增国金证券股份有限公司为旗下中银证券中证 A500 指数型证券投资基金销售机构并进行费率优惠的公告	规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 4 月 14 日
8	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
9	中银证券中证 A500 指数型证券投资基金 2026 年第一季度报告	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	中银国际证券股份有限公司关于旗下部分基金新增上海万得基金销售有限公司为销售机构并进行费率优惠的公告	规定报刊、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 4 月 23 日
11	中银国际证券股份有限公司关于旗	规定报刊、公司官网及	2026 年 6 月 15 日

	下部分基金新增中信建投证券股份有限公司为销售机构并进行费率优惠的公告	中国证监会基金电子披露网站	
12	中银证券中证 A500 指数型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 6 月 27 日
13	中银证券中证 A500 指数型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	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

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

2026 年 8 月 31 日