

国寿安保中证 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：国寿安保基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 29 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
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	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	11
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	15
§ 7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
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	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	50
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	50
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	50
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	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50

7.12 投资组合报告附注	51
§ 8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 盈利投资者数量占比	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	52
§ 9 开放式基金份额变动	52
§ 10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
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	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4 基金投资策略的改变	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	53
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	53
10.8 其他重大事件	55
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	55
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	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	55
§ 12 备查文件目录	55
12.1 备查文件目录	55
12.2 存放地点	56
12.3 查阅方式	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	国寿安保中证 500ETF
场内简称	中证 500ETF 国寿
基金主代码	510560
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 29 日
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	62,318,687.00 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	2015 年 7 月 3 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求偏离度和误差最小化。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。
业绩比较基准	中证 500 指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，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近的风险收益特征。

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		国寿安保基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	韩占锋	任航
	联系电话	010-50850888	010-66060069
	电子邮箱	service@gsfunds.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4009-258-258	95599
传真		010-50850777	010-68121816
注册地址		上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 306 号	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		北京市西城区金融大街 28 号院盈泰商务中心 2 号楼 11 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		100033	100031
法定代表人		于泳	谷澍

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	http://www.gsfunds.com.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	47,366,349.90
本期利润	40,751,232.38
加权平均基金份额本期利润	0.4868
本期加权平均净值利润率	24.16%
本期基金份额净值增长率	23.12%
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	4,926,375.11
期末可供分配基金份额利润	0.0791
期末基金资产净值	139,514,782.58
期末基金份额净值	2.2387
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	3.66%

注：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。

上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后投资人的实际收益水平要低于所列数字。

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	20.62 %	1.63 %	18.56 %	1.65 %	2.06 %	-0.02 %
过去六个月	23.12 %	1.65 %	20.97 %	1.66 %	2.15 %	-0.01 %
过去一年	58.17 %	1.41 %	52.68 %	1.42 %	5.49 %	-0.01 %
过去三年	65.40 %	1.47 %	50.55 %	1.49 %	14.85 %	-0.02 %
过去五年	49.31 %	1.35 %	32.65 %	1.36 %	16.66 %	-0.01 %

过去七年	111.00 %	1.35 %	82.43 %	1.36 %	28.57 %	-0.01 %
过去十年	76.32 %	1.34 %	47.49 %	1.35 %	28.83 %	-0.01 %
自基金合同生效起至今	3.66 %	1.56 %	-8.48 %	1.58 %	12.14 %	-0.02 %

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

国寿安保中证500ETF份额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：本基金的基金合同于 2015 年 05 月 29 日生效，按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起 3 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同关于投资范围和投资限制的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。图示日期为 2015 年 05 月 29 日至 2026 年 06 月 30 日。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国寿安保基金管理有限公司经中国证监会证监许可〔2013〕1308 号文核准，于 2013 年 10 月 29 日设立，公司注册资本 12.88 亿元人民币，公司股东为中国人寿资产管理有限公司，其持有股份 85.03%，National Mutual Funds Management Ltd.（国家共同基金管理有限公司），其持有股份 14.97%。

截至 2026 年 06 月 30 日，公司共管理 107 只公募证券投资基金和部分私募资产管理计划。

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		
李康	本基金的基金经理	2015 年 5 月 29 日	-	17 年	博士研究生，曾任中国国际金融有限公司量化投资研究员、长盛基金管理有限公司金融工程研究员。2013 年 11 月加入国寿安保基金管理有限公司，历任基金经理助理、基金经理，现任国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保国证创业板中盘精选 88 交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国寿安保中证 A500 红利低波动交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保中证 800 指数增强型证券投资基金和国寿安保稳泽两年持有期混合型证券投资基金基金经理。

注：任职日期为本基金管理人对外披露的任职日期。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于基金份额持有人为宗旨，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。在本报告期内，基金运作合法合规，不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平

交易相关制度。

本基金管理人于每季度和年度对公司管理的不同投资组合进行了同向交易价差分析，采用了日内、3 日内、5 日内的时间窗口，假设不同组合间价差为零，进行了 T 分布检验。经分析，本报告期未发现本基金管理人管理的不同投资组合间有同向交易价差异常的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为；且不存在所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

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

报告期内，本基金严格遵守基金合同，紧密追踪标的指数。

本基金跟踪误差主要源自股票停牌和成份股调整等因素引起的成份股权重偏离。日常申赎、公司行为和市场波动等因素，也带来一定的跟踪误差。本基金管理人采用量化分析手段，通过适当的策略尽量克服对跟踪误差不利因素的影响。并且，逐日跟踪实际组合与标的指数表现的偏离，定期分析优化跟踪偏离度管理方案。

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 2.2387 元，本报告期基金份额净值增长率为 23.12%，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 股市场呈现极致结构化，科创 50 上涨 64.25%，创业板指上涨 35.58%，半导体、电子与通信行业分别大涨 106.20%、86.29% 和 73.59%，但全市场仅约三成个股上涨，沪深 300 上涨 7.55%，与此同时上证 50 下跌 1.38%。宏观经济方面，国内 GDP 上半年同比增长 4.7%，其中一季度 5.0%、二季度回落至 4.3%，总量承压但价格端出现积极变化，GDP 平减指数近十三个季度以来首次转正，PPI 由负转正，上半年累计上涨 1.5%。六月制造业 PMI 回升至 50.3%，连续四个月保持在扩张区间，高技术制造业增加值同比增长 13.3%，集成电路产量同比增长 23.1%，新动能以两成多的增加值占比贡献了近五成的工业增长，成为经济转型的核心动能。但内需复苏基础尚不牢固，

上半年社零累计仅增长 1.3%，且六月当月同比滑落至 1.0%，地产投资上半年累计下降 18.0%，消费与地产仍是主要拖累。产业政策层面，科技仍然是主要抓手，“十五五”规划纲要对培育壮大新兴产业和未来产业作出专门部署，提出前瞻布局量子科技、生物制造、氢能、脑机接口和具身智能等未来产业。国常会明确将推进新型工业化作为长期战略任务，坚持智能化、绿色化、融合化方向，强调要加力推进人工智能创新突破，加快关键技术攻关和超大规模智算集群建设，深入实施“人工智能+”行动。政策已从技术突破转向全链条协同布局。货币政策方面，LPR 连续保持不变，央行保持较强政策定力。外部环境方面，美联储加息预期升温压制市场风险偏好，东欧与中东地缘冲突反复加剧供应链风险忧虑，油价成为全球通胀与货币政策路径的一个关键变量。展望下半年，市场核心特征可能由上半年的估值扩张转向业绩验证，业绩兑现确定性强的硬核科技板块的较高估值有望通过盈利上行逐步消化，企业盈利增长逐步带动居民收入和消费提升，经济稳中向好背景下消费、医药和红利等低位板块存在修复机会。整体而言，中国经济正处于新旧动能加速切换的关键期，科技主线明确但需关注阶段性交易拥挤风险，消费红利等低估价值板块具备中长期配置价值。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人设有基金估值委员会，估值委员会负责人由主管运营工作的公司领导担任，委员由运营管理部负责人、合规管理部负责人、研究部负责人以及各投资部门负责人组成，估值委员会成员均具有专业胜任能力和相关工作经验。估值委员会采取定期或临时会议的方式召开会议评估基金的估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性、适用性的情况时，运营管理部及时提请估值委员会召开会议修订估值方法并履行信息披露义务，以保证其持续适用。相关基金经理和研究员可列席会议，向估值委员会提出估值意见或建议，但不参与具体的估值流程。

上述参与估值流程的各方不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司分别签署服务协议，其中中债金融估值中心有限公司按约定提供固定收益品种信用减值数据和在银行间同业市场交易的固定收益品种估值数据，中证指数有限公司提供在交易所市场交易的固定收益品种估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 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，中国农业银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）在本基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对本基金的投资运作情况进行了必要的监督，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支、利润分配等方面进行了复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，以自身能够获取的数据和信息为限，对本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行核查，以上内容真实、准确、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： 国寿安保中证 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	2,466,444.06	3,052,435.49
结算备付金		174,847.57	-

存出保证金		49,367.37	6,780.33
交易性金融资产	6.4.7.2	137,968,160.90	215,796,465.57
其中：股票投资		137,918,159.55	215,773,465.22
基金投资		-	-
债券投资		50,001.35	23,000.35
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		6,676.85	174,674.19
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		140,665,496.75	219,030,355.58
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		989,186.35	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		53,458.61	89,190.16
应付托管费		10,691.71	17,838.03
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	97,377.50	148,727.63
负债合计		1,150,714.17	255,755.82
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	134,588,407.47	259,849,834.02
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	4,926,375.11	-41,075,234.26

净资产合计		139,514,782.58	218,774,599.76
负债和净资产总计		140,665,496.75	219,030,355.58

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.2387 元，基金份额总额 62,318,687.00 份。

6.2 利润表

会计主体：国寿安保中证 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		41,322,447.14	10,106,497.34
1. 利息收入		3,902.47	5,160.09
其中：存款利息收入	6.4.7.13	3,902.47	5,160.09
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）		47,679,948.90	2,369,166.44
其中：股票投资收益	6.4.7.14	46,769,987.28	650,084.82
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	36,652.08	11,871.58
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	873,309.54	1,707,210.04
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	-6,615,117.52	7,733,641.60
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	253,713.29	-1,470.79
减：二、营业总支出		571,214.76	613,110.05
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	417,594.08	428,029.29
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	83,518.81	85,605.80
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. 01
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	70, 101. 87	99, 474. 95
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		40, 751, 232. 38	9, 493, 387. 29
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		40, 751, 232. 38	9, 493, 387. 29
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		40, 751, 232. 38	9, 493, 387. 29

6.3 净资产变动表

会计主体：国寿安保中证 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、上期期末净资产	259, 849, 834. 02	-	-41, 075, 234. 26	218, 774, 599. 76
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	259, 849, 834. 02	-	-41, 075, 234. 26	218, 774, 599. 76
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-125, 261, 426. 55	-	46, 001, 609. 37	-79, 259, 817. 18
（一）、综合收益总额	-	-	40, 751, 232. 38	40, 751, 232. 38
（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）	-125, 261, 426. 55	-	5, 250, 376. 99	-120, 011, 049. 56
其中：1. 基金申购款	17, 277, 438. 15	-	-2, 466, 725. 23	14, 810, 712. 92
2. 基金赎回款	-142, 538, 864. 70	-	7, 717, 102. 22	-134, 821, 762. 48
（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	134, 588, 407. 47	-	4, 926, 375. 11	139, 514, 782. 58
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	未分配利润	净资产合计

		综合 收益		
一、上期期末净资产	277,127,272.16	-	-105,021,699.64	172,105,572.52
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	277,127,272.16	-	-105,021,699.64	172,105,572.52
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-4,319,359.53	-	11,009,653.14	6,690,293.61
（一）、综合收益总额	-	-	9,493,387.29	9,493,387.29
（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）	-4,319,359.53	-	1,516,265.85	-2,803,093.68
其中：1. 基金申购款	-	-	-	-
2. 基金赎回款	-4,319,359.53	-	1,516,265.85	-2,803,093.68
（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	272,807,912.63	-	-94,012,046.50	178,795,866.13

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：

刘忠江

基金管理人负责人

王文英

主管会计工作负责人

于晓树

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国寿安保中证 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[2015]485 号《关于准予国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金注册的批复》注册，由国寿安保基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国寿安保中证 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。本基金为交易型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 665,796,867.00 元(含募集股票市值)，业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2015)验字第 61090605_A03 号予以验证。经向中国证监会备案，《国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2015 年 05 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 665,869,631.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 72,764.00

份基金份额。本基金的基金管理人为国寿安保基金管理有限公司(以下简称“国寿安保”),基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“农业银行”)。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2015]268 号核准,本基金 308,318,687.00 份基金份额于 2015 年 7 月 3 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《国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、证券公司短期公司债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、国债期货以及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)。在建仓完成后,本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%,其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债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,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为:标的指数,本基金标的指数为中证 500 指数。

本基金的基金管理人国寿安保基金管理有限公司以本基金为目标 ETF,募集成立了国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“国寿安保中证 500ETF 联接”)。国寿安保中证 500ETF 联接为契约型开放式基金,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

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》《证券投资基金会计核算业务指引》、《国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期所采用的会计政策和会计估计与上年度会计报表相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部、国家税务总局公告2025年第4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金管理人为增值税纳税人。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。对本基金在2018年1月1日前运营过程

中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从本基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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；对除持有金融债券外的金融同业往来取得的利息收入免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。本基金管理人运营本基金转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2)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。

(3)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。对本基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对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。

(4)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。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

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

活期存款	2,466,444.06
等于：本金	2,466,220.48
加：应计利息	223.58
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	2,466,444.06

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	106,522,346.33	-	137,918,159.55	31,395,813.22
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	50,000.00	1.35	50,001.35
	银行间市场	-	-	-
	合计	50,000.00	1.35	50,001.35
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	106,572,346.33	1.35	137,968,160.90	31,395,813.22

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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

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

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

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

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	29,837.35
其中：交易所市场	29,837.35
银行间市场	—
应付利息	—
预提费用	67,540.15
合计	97,377.50

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	120,318,687.00	259,849,834.02
本期申购	8,000,000.00	17,277,438.15
本期赎回（以“-”号填列）	-66,000,000.00	-142,538,864.70
基金拆分/份额折算前	—	—
基金拆分/份额折算调整	—	—
本期申购	—	—
本期赎回（以“-”号填列）	—	—
本期末	62,318,687.00	134,588,407.47

注：根据本基金的基金合同和招募说明书的规定，基金管理人确定 2015 年 6 月 15 日为本基

金折算日，将折算前的基金份额总额 665,869,631.00 份折算为 308,318,687.00 份，折算比例为 0.46303161。

6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期末无其他综合收益。

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	-43,437,389.45	2,362,155.19	-41,075,234.26
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-43,437,389.45	2,362,155.19	-41,075,234.26
本期利润	47,366,349.90	-6,615,117.52	40,751,232.38
本期基金份额交易产生的变动数	10,317,376.23	-5,066,999.24	5,250,376.99
其中：基金申购款	-900,354.75	-1,566,370.48	-2,466,725.23
基金赎回款	11,217,730.98	-3,500,628.76	7,717,102.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,246,336.68	-9,319,961.57	4,926,375.11

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	3,573.81
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	272.22
其他	56.44
合计	3,902.47

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	33,165,244.20
股票投资收益——赎回差价收入	13,604,743.08
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	46,769,987.28

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	106,464,099.01
减：卖出股票成本总额	73,206,017.15
减：交易费用	92,837.66
买卖股票差价收入	33,165,244.20

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	134,821,762.48
减：现金支付赎回款总额	69,507,183.48
减：赎回股票成本总额	51,709,835.92
减：交易费用	-
赎回差价收入	13,604,743.08

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	3.31
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	36,648.77
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	36,652.08

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	75,154.07
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	38,500.00
减：应计利息总额	2.31

减：交易费用	2.99
买卖债券差价收入	36,648.77

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.18 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

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	873,309.54
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	873,309.54

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	-6,615,117.52
股票投资	-6,615,117.52
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	-6,615,117.52

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	253,713.29
合计	253,713.29

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

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

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	8,032.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	2,561.72
合计	70,101.87

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国寿安保	基金管理人
农业银行	基金托管人
中国人寿资产管理有限公司（简称“国寿资产”）	基金管理人的股东
国家共同基金管理有限公司（简称“国家共同基金”）	基金管理人的股东

中国人寿保险（集团）公司（简称“集团公司”）	基金管理人的最终控制人
中国人寿保险股份有限公司（简称“中国人寿”）	与基金管理人同受集团公司控制的公司
国寿财富管理有限公司（简称“国寿财富”）	基金管理人的子公司
国寿安保中证 500ETF 联接	本基金的联接基金

注：以下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

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

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	417,594.08	428,029.29
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,156.28	1,159.87
应支付基金管理人的净管理费	415,437.80	426,869.42

注： 基金管理费每日计提，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E\times 0.50\%/ \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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托管费	83,518.81	85,605.80

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E\times 0.10\%/ \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均无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

本基金于本报告期及上年度可比期间均无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。

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

本基金于本报告期及上年度可比期间均无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。

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

本基金的管理人于本报告期及上年度可比期间均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（%）
国寿安保中证 500ETF联接	56,622,386.00	90.86	116,525,786.00	96.85

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
农业银行	2,466,444.06	3,573.81	2,349,734.20	5,092.99

注：本基金的银行存款由基金托管人农业银行保管，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金于本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金于本报告期间未进行利润分配。

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

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股流通受限	28.00	27.78	53	1,484.00	1,472.34	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	6 个月	新股流通受限	10.11	10.11	3,925	39,681.75	39,681.75	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	6 日	新股未上市	10.11	10.11	1,681	16,994.91	16,994.91	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	7.82	20.74	642	5,020.44	13,315.08	-
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	18.38	16.78	58	1,066.04	973.24	-
001365	天海电子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	新股流通受限	27.19	31.31	164	4,459.16	5,134.84	-
001393	维通利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新股流通受限	30.38	38.99	116	3,524.08	4,522.84	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	10.12	27.73	668	6,760.16	18,523.64	-
301513	尚水智能	2026 年 4 月 10 日	6 个月	新股流通受限	26.66	50.96	101	2,692.66	5,146.96	-
301531	春光集团	2026 年 4 月 28 日	6 个月	新股流通受限	13.30	51.56	175	2,327.50	9,023.00	-

301599	理奇智能	2026 年 4 月 22 日	6 个月	新股流通受限	13.91	32.47	193	2,684.63	6,266.71	-
301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新股流通受限	46.08	463.33	244	11,243.52	113,052.52	-
301669	高特电子	2026 年 6 月 2 日	6 个月	新股流通受限	7.08	28.40	265	1,876.20	7,526.00	-
301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	78.38	121.77	37	2,900.06	4,505.49	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股流通受限	21.93	77.78	164	3,596.52	12,755.92	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	24.68	86.80	99	2,443.32	8,593.20	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股流通受限	33.49	33.93	30	1,004.70	1,017.90	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股流通受限	21.88	25.52	66	1,444.08	1,684.32	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	17.70	84.32	102	1,805.40	8,600.64	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股流通受限	17.52	35.92	908	15,908.16	32,615.36	-
688781	视涯科技	2026 年 3 月 18 日	9 个月	新股流通受限	22.68	42.16	1,471	33,362.28	62,017.36	-
688790	昂瑞微	2025 年 12 月 9 日	9 个月	新股流通受限	83.06	126.45	580	48,174.80	73,341.00	-
688795	摩尔线程	2025 年 11 月 26 日	9 个月	新股流通受限	114.28	676.94	787	89,938.36	532,751.78	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	44.56	468.67	52	2,317.12	24,370.84	-
688802	沐曦股份	2025 年 12 月 9 日	9 个月	新股流通受限	104.66	768.89	566	59,237.56	435,191.74	-
688808	联讯仪器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新股流通受限	81.88	1,584.33	38	3,111.44	60,204.54	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	236	4,644.48	33,391.64	-

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	18 日	新债未上市	100.00	100.00	240	24,000.00	24,000.32	-
113704	春风转债	2026 年 6 月 10 日	18 日	新债未上市	100.00	100.00	200	20,000.00	20,000.92	-
118071	华峰转	2026 年 6 月	18 日	新债未	100.00	100.00	60	6,000.00	6,000.11	-

	债	23 日		上市						
--	---	------	--	----	--	--	--	--	--	--

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有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

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系。董事会负责公司整体风险的预防和控制，确定公司风险战略，审核、监督公司风险控制制度的有效执行，对有效的风险管理承担最终责任。董事会下设风险管理委员会，负责对公司经营管理和基金业务运作的风险控制及合法合规性进行审议、监督和检查。管理层对有效的风险管理承担直接责任，保证风险管理体系的持续有效运转，使公司风险管理的战略和政策要求及其各方面的具体工作落到实处。公司设督察长一名，负责牵头开展风险管理工作，监督检查公司内部风险控制情况，参与各项决策的风险评估及审批。公司设立合规管理部、监察稽核部两个独立的风险管理职能部门，由督察长领导，对督察长负责，并向督察长汇报工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的

量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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托管人和其他拥有相关资质的银行，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，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人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。

于本报告期末，除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他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，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照相关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。

本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%。本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。本基金与由本

基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。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。

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。

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	2,466,444.06	-	-	-	2,466,444.06
结算备付金	174,847.57	-	-	-	174,847.57
存出保证金	49,367.37	-	-	-	49,367.37
交易性金融资产	-	-	50,001.35	137,918,159.55	137,968,160.90
应收清算款	-	-	-	6,676.85	6,676.85
资产总计	2,690,659.00	-	50,001.35	137,924,836.40	140,665,496.75
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	53,458.61	53,458.61
应付托管费	-	-	-	10,691.71	10,691.71
应付清算款	-	-	-	989,186.35	989,186.35
其他负债	-	-	-	97,377.50	97,377.50
负债总计	-	-	-	1,150,714.17	1,150,714.17
利率敏感度缺口	2,690,659.00	-	50,001.35	136,774,122.23	139,514,782.58
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	3,052,435.49	-	-	-	3,052,435.49
存出保证金	6,780.33	-	-	-	6,780.33
交易性金融资产	-	-	23,000.35	215,773,465.22	215,796,465.57
应收清算款	-	-	-	174,674.19	174,674.19
资产总计	3,059,215.82	-	23,000.35	215,948,139.41	219,030,355.58
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	89,190.16	89,190.16
应付托管费	-	-	-	17,838.03	17,838.03
其他负债	-	-	-	148,727.63	148,727.63
负债总计	-	-	-	255,755.82	255,755.82
利率敏感度缺口	3,059,215.82	-	23,000.35	215,692,383.59	218,774,599.76

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2026 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.04%（2025 年 12 月 31 日：0.01%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（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。

6.4.13.4.3 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。本基金主要投资于标的指数成分股、备选成分股，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，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	137,918,159.55	98.86	215,773,465.22	98.63
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	50,001.35	0.04	23,000.35	0.01
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	137,968,160.90	98.89	215,796,465.57	98.64

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据组合的净值数据和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
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）
	+5%	6,922,767.57	10,832,366.64
	-5%	-6,922,767.57	-10,832,366.64

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	136,385,483.99	214,914,026.71
第二层次	106,678.01	23,000.35
第三层次	1,475,998.90	859,438.51
合计	137,968,160.90	215,796,465.57

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、债券和基金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	137,918,159.55	98.05
	其中：股票	137,918,159.55	98.05
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	50,001.35	0.04
	其中：债券	50,001.35	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	2,641,291.63	1.88
8	其他各项资产	56,044.22	0.04
9	合计	140,665,496.75	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	445,891.00	0.32
B	采矿业	4,246,949.73	3.04
C	制造业	103,970,358.38	74.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,387,127.26	2.43
E	建筑业	806,854.00	0.58
F	批发和零售业	2,563,788.32	1.84
G	交通运输、仓储和邮政业	1,663,009.24	1.19
H	住宿和餐饮业	100,744.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,871,147.70	6.36
J	金融业	7,500,864.58	5.38
K	房地产业	552,430.00	0.40
L	租赁和商务服务业	1,389,351.20	1.00
M	科学研究和技术服务业	990,369.26	0.71
N	水利、环境和公共设施管理业	470,356.20	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	317,973.64	0.23
R	文化、体育和娱乐业	640,945.04	0.46
S	综合	-	-
	合计	137,918,159.55	98.86

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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

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	1,200	2,263,200.00	1.62
2	300604	长川科技	5,300	1,809,526.00	1.30
3	001309	德明利	1,900	1,791,510.00	1.28
4	688347	华虹宏力	5,000	1,681,500.00	1.21
5	688120	华海清科	4,843	1,560,317.74	1.12
6	002281	光迅科技	5,800	1,490,252.00	1.07
7	002008	大族激光	9,900	1,486,089.00	1.07
8	300857	协创数据	4,080	1,386,792.00	0.99
9	300136	信维通信	11,600	1,383,300.00	0.99
10	688361	中科飞测	2,949	1,268,070.00	0.91
11	300475	香农芯创	3,900	1,170,000.00	0.84
12	300223	北京君正	4,600	1,144,940.00	0.82
13	002436	兴森科技	20,400	1,039,380.00	0.74
14	300285	国瓷材料	9,600	990,528.00	0.71
15	600105	永鼎股份	14,300	964,964.00	0.69
16	300054	鼎龙股份	9,100	964,327.00	0.69
17	300666	江丰电子	2,500	921,500.00	0.66
18	688777	中控技术	7,800	916,500.00	0.66
19	688200	华峰测控	1,700	892,670.00	0.64
20	300757	罗博特科	1,400	866,600.00	0.62
21	000021	深科技	13,200	848,364.00	0.61
22	688037	芯源微	1,900	834,195.00	0.60
23	601869	长飞光纤	1,500	818,850.00	0.59
24	002851	麦格米特	4,700	785,746.00	0.56
25	300548	长芯博创	2,800	778,400.00	0.56
26	688019	安集科技	2,276	772,610.96	0.55
27	300346	南大光电	8,300	768,995.00	0.55
28	002409	雅克科技	3,400	763,300.00	0.55
29	300567	精测电子	2,400	762,240.00	0.55

30	600498	烽火通信	9,900	728,640.00	0.52
31	002407	多氟多	14,300	718,289.00	0.51
32	002185	华天科技	31,900	711,689.00	0.51
33	688002	睿创微纳	4,586	709,408.34	0.51
34	002138	顺络电子	9,700	709,070.00	0.51
35	688313	仕佳光子	3,800	701,670.00	0.50
36	600879	航天电子	32,200	685,538.00	0.49
37	300620	光库科技	1,800	680,760.00	0.49
38	300395	菲利华	5,000	668,650.00	0.48
39	688017	绿的谐波	1,600	668,576.00	0.48
40	688469	芯联集成	61,400	651,454.00	0.47
41	300390	天华新能	6,940	648,959.40	0.47
42	301526	国际复材	13,600	634,712.00	0.45
43	688702	盛科通信	1,600	623,984.00	0.45
44	300373	扬杰科技	3,900	613,197.00	0.44
45	002273	水晶光电	16,729	593,544.92	0.43
46	300058	蓝色光标	43,120	593,331.20	0.43
47	300037	新宙邦	6,300	584,955.00	0.42
48	603256	宏和科技	2,200	583,726.00	0.42
49	688172	燕东微	6,900	577,254.00	0.41
50	300751	迈为股份	2,000	564,920.00	0.40
51	605358	立昂微	7,200	558,720.00	0.40
52	301377	鼎泰高科	1,000	550,900.00	0.39
53	688099	晶晨股份	5,200	535,080.00	0.38
54	600988	赤峰黄金	20,300	534,296.00	0.38
55	688795	摩尔线程	787	532,751.78	0.38
56	605589	圣泉集团	8,200	521,274.00	0.37
57	600885	宏发股份	15,066	519,626.34	0.37
58	002738	中矿资源	8,680	512,033.20	0.37
59	600392	盛和资源	17,095	508,918.15	0.36
60	002126	银轮股份	10,200	507,960.00	0.36
61	000960	锡业股份	11,800	503,742.00	0.36
62	600601	方正科技	35,900	496,856.00	0.36
63	000831	中国稀土	8,900	493,861.00	0.35
64	600141	兴发集团	10,280	482,851.60	0.35
65	002812	恩捷股份	7,100	475,061.00	0.34
66	001389	广合科技	2,000	474,500.00	0.34
67	688234	天岳先进	2,698	468,129.98	0.34
68	600378	昊华科技	6,200	467,356.00	0.33
69	601179	中国西电	31,200	465,504.00	0.33
70	301358	湖南裕能	6,100	462,807.00	0.33
71	600497	驰宏锌锗	36,900	446,859.00	0.32
72	002195	岩山科技	68,185	445,929.90	0.32

73	300570	太辰光	1,800	444,078.00	0.32
74	002850	科达利	2,300	435,390.00	0.31
75	688802	沐曦股份	566	435,191.74	0.31
76	688629	华丰科技	2,300	431,273.00	0.31
77	600157	永泰能源	265,900	428,099.00	0.31
78	002261	拓维信息	15,100	422,951.00	0.30
79	688052	纳芯微	1,440	415,166.40	0.30
80	600711	盛屯矿业	37,700	413,569.00	0.30
81	600909	华安证券	36,790	408,736.90	0.29
82	002340	格林美	61,300	405,193.00	0.29
83	600143	金发科技	26,100	403,245.00	0.29
84	688027	国盾量子	800	403,208.00	0.29
85	300017	网宿科技	30,000	390,300.00	0.28
86	002821	凯莱英	2,400	388,800.00	0.28
87	000783	长江证券	39,700	387,075.00	0.28
88	002131	利欧股份	81,300	386,175.00	0.28
89	003031	中瓷电子	2,140	385,842.00	0.28
90	600352	浙江龙盛	31,800	385,098.00	0.28
91	601555	东吴证券	48,430	383,565.60	0.27
92	688411	海博思创	1,300	378,560.00	0.27
93	301611	珂玛科技	2,100	378,147.00	0.27
94	002203	海亮股份	16,500	377,025.00	0.27
95	601233	桐昆股份	17,400	376,710.00	0.27
96	603659	璞泰来	13,000	376,090.00	0.27
97	002966	苏州银行	53,760	374,169.60	0.27
98	688220	翱捷科技	3,000	372,960.00	0.27
99	300339	润和软件	9,600	369,696.00	0.26
100	688213	思特威	3,400	364,038.00	0.26
101	301200	大族数控	1,000	360,650.00	0.26
102	688578	艾力斯	3,300	360,360.00	0.26
103	300759	康龙化成	12,400	358,732.00	0.26
104	688235	百济神州	1,400	356,454.00	0.26
105	603308	应流股份	5,800	350,320.00	0.25
106	688122	西部超导	5,540	347,967.40	0.25
107	601108	财通证券	39,600	342,540.00	0.25
108	002472	双环传动	8,200	340,382.00	0.24
109	300207	欣旺达	17,800	338,022.00	0.24
110	300001	特锐德	8,900	336,687.00	0.24
111	688385	复旦微电	4,700	335,063.00	0.24
112	002517	恺英网络	20,500	333,125.00	0.24
113	603129	春风动力	1,300	332,540.00	0.24
114	601958	金钼股份	11,800	331,698.00	0.24
115	002797	第一创业	50,400	331,128.00	0.24

116	300458	全志科技	8,380	330,674.80	0.24
117	002601	龙佰集团	20,000	329,600.00	0.24
118	688387	信科移动	16,600	329,344.00	0.24
119	601198	东兴证券	23,700	322,083.00	0.23
120	601991	大唐发电	45,300	320,724.00	0.23
121	300115	长盈精密	11,400	318,516.00	0.23
122	002155	湖南黄金	13,165	314,248.55	0.23
123	688322	奥比中光	2,400	313,320.00	0.22
124	000703	恒逸石化	22,900	310,753.00	0.22
125	600563	法拉电子	1,600	305,280.00	0.22
126	002465	海格通信	23,900	305,203.00	0.22
127	603156	养元饮品	6,200	304,234.00	0.22
128	603179	新泉股份	6,120	303,858.00	0.22
129	601665	齐鲁银行	52,500	302,925.00	0.22
130	688301	奕瑞科技	2,431	301,444.00	0.22
131	002056	横店东磁	9,800	298,704.00	0.21
132	300454	深信服	3,100	298,220.00	0.21
133	600884	杉杉股份	22,000	298,100.00	0.21
134	603650	彤程新材	3,000	293,940.00	0.21
135	600707	彩虹股份	17,200	290,508.00	0.21
136	601162	天风证券	86,200	290,494.00	0.21
137	300024	机器人	15,000	289,950.00	0.21
138	688676	金盘科技	3,400	287,776.00	0.21
139	002402	和而泰	11,100	286,713.00	0.21
140	688331	荣昌生物	2,200	286,572.00	0.21
141	002130	沃尔核材	15,100	286,296.00	0.21
142	000060	中金岭南	37,400	283,118.00	0.20
143	002429	兆驰股份	27,200	282,608.00	0.20
144	601099	太平洋	83,200	280,384.00	0.20
145	300012	华测检测	20,200	279,972.00	0.20
146	600109	国金证券	31,700	278,326.00	0.20
147	000878	云南铜业	17,500	277,900.00	0.20
148	603379	三美股份	3,640	276,239.60	0.20
149	002432	九安医疗	3,900	275,652.00	0.20
150	000893	亚钾国际	6,700	273,963.00	0.20
151	002271	东方雨虹	23,000	273,010.00	0.20
152	300496	中科创达	4,400	271,876.00	0.19
153	002414	高德红外	20,500	271,830.00	0.19
154	603979	金诚信	4,600	271,538.00	0.19
155	600256	广汇能源	54,700	270,218.00	0.19
156	300623	捷捷微电	6,000	269,940.00	0.19
157	000034	神州数码	9,720	269,730.00	0.19
158	603688	石英股份	3,250	268,482.50	0.19

159	688266	泽璟制药	2,300	268,318.00	0.19
160	600298	安琪酵母	7,400	267,880.00	0.19
161	600060	海信视像	9,600	267,552.00	0.19
162	002444	巨星科技	8,600	267,460.00	0.19
163	002487	大金重工	4,600	266,662.00	0.19
164	002335	科华数据	6,280	266,586.00	0.19
165	300474	景嘉微	4,400	266,112.00	0.19
166	688728	格科微	12,500	263,000.00	0.19
167	300763	锦浪科技	2,900	262,015.00	0.19
168	000661	长春高新	3,900	259,740.00	0.19
169	601128	常熟银行	44,564	259,362.48	0.19
170	600021	上海电力	17,200	259,204.00	0.19
171	600699	均胜电子	11,960	258,455.60	0.19
172	601696	中银证券	20,400	258,060.00	0.18
173	301536	星宸科技	2,000	257,420.00	0.18
174	601577	长沙银行	29,500	256,945.00	0.18
175	601615	明阳智能	22,100	255,697.00	0.18
176	000733	振华科技	4,500	254,880.00	0.18
176	002756	永兴材料	4,500	254,880.00	0.18
178	603920	世运电路	5,300	254,612.00	0.18
179	300748	金力永磁	8,240	254,204.00	0.18
180	603606	东方电缆	6,060	251,550.60	0.18
181	002025	航天电器	3,300	251,526.00	0.18
182	002078	太阳纸业	20,100	251,049.00	0.18
183	300073	当升科技	5,200	249,808.00	0.18
184	603087	甘李药业	4,400	249,744.00	0.18
185	300142	沃森生物	19,200	249,408.00	0.18
186	002157	正邦科技	88,700	249,247.00	0.18
187	300432	富临精工	12,300	247,107.00	0.18
188	300919	中伟新材	5,600	245,000.00	0.18
189	688343	云天励飞	3,000	244,980.00	0.18
190	000423	东阿阿胶	5,400	244,944.00	0.18
191	688599	天合光能	17,100	241,452.00	0.17
192	002252	上海莱士	55,500	240,870.00	0.17
193	688608	恒玄科技	1,440	240,753.60	0.17
194	300953	震裕科技	1,800	240,660.00	0.17
195	300724	捷佳伟创	3,400	240,040.00	0.17
196	688169	石头科技	2,500	237,425.00	0.17
197	000728	国元证券	31,500	235,935.00	0.17
198	603119	浙江荣泰	3,500	232,190.00	0.17
199	603290	斯达半导	1,500	229,410.00	0.16
200	002064	华峰化学	23,900	226,811.00	0.16
201	688375	国博电子	2,139	223,097.70	0.16

202	002831	裕同科技	6,237	221,787.72	0.16
203	001203	大中矿业	7,400	221,630.00	0.16
204	000786	北新建材	12,200	220,698.00	0.16
205	600171	上海贝岭	6,900	220,386.00	0.16
206	688018	乐鑫科技	1,719	219,894.48	0.16
207	688180	君实生物	6,500	219,830.00	0.16
208	688187	时代电气	3,200	219,712.00	0.16
209	300677	英科医疗	5,520	216,218.40	0.15
210	300679	电连技术	3,600	215,964.00	0.15
211	300383	光环新网	17,300	215,212.00	0.15
212	603806	福斯特	12,700	213,233.00	0.15
213	600177	雅戈尔	28,200	212,346.00	0.15
214	600516	方大炭素	34,400	212,248.00	0.15
215	000519	中兵红箭	10,062	212,006.34	0.15
216	688065	凯赛生物	4,400	210,540.00	0.15
217	603160	汇顶科技	3,400	209,814.00	0.15
218	002673	西部证券	32,300	209,627.00	0.15
219	688188	柏楚电子	1,961	209,238.70	0.15
220	601699	潞安环能	14,600	208,488.00	0.15
221	300972	万辰集团	1,200	208,092.00	0.15
222	600642	申能股份	23,800	207,774.00	0.15
223	688568	中科星图	5,000	207,350.00	0.15
224	000559	万向钱潮	16,000	206,880.00	0.15
225	600637	东方明珠	24,600	204,426.00	0.15
226	000623	吉林敖东	11,500	203,895.00	0.15
227	002624	完美世界	16,300	202,446.00	0.15
228	603225	新凤鸣	10,240	201,216.00	0.14
229	603345	安井食品	2,500	200,475.00	0.14
230	300699	光威复材	6,980	199,977.00	0.14
231	001696	宗申动力	9,600	199,776.00	0.14
232	000750	国海证券	53,820	198,057.60	0.14
233	000983	山西焦煤	34,100	197,780.00	0.14
234	002085	万丰奥威	17,800	197,402.00	0.14
235	600100	同方股份	28,700	196,595.00	0.14
236	002318	久立特材	8,200	195,980.00	0.14
237	600369	西南证券	48,600	195,372.00	0.14
238	300558	贝达药业	3,000	195,210.00	0.14
239	002739	儒意电影	20,300	194,880.00	0.14
240	600499	科达制造	14,000	193,200.00	0.14
241	002065	东华软件	27,000	192,780.00	0.14
242	600595	中孚实业	34,200	192,204.00	0.14
243	603699	纽威股份	3,800	191,140.00	0.14
244	600536	中国软件	6,781	190,681.72	0.14

245	002266	浙富控股	37,680	190,660.80	0.14
246	603596	伯特利	7,640	189,777.60	0.14
247	300627	华测导航	6,660	189,144.00	0.14
248	002044	美年健康	37,600	189,128.00	0.14
249	688772	珠海冠宇	9,600	188,448.00	0.14
250	000400	许继电气	8,600	186,620.00	0.13
251	002223	鱼跃医疗	7,250	186,035.00	0.13
252	688617	惠泰医疗	1,023	185,735.88	0.13
253	000629	钒钛股份	55,600	185,704.00	0.13
254	000155	川能动力	15,500	185,690.00	0.13
255	601016	节能风电	47,840	185,619.20	0.13
256	600985	淮北矿业	13,200	185,460.00	0.13
257	600521	华海药业	12,800	184,320.00	0.13
258	300002	神州泰岳	23,600	184,316.00	0.13
259	600862	中航高科	10,200	183,906.00	0.13
260	601212	白银有色	36,200	183,896.00	0.13
261	601216	君正集团	41,200	183,752.00	0.13
262	300003	乐普医疗	15,500	183,675.00	0.13
263	601997	贵阳银行	35,800	183,654.00	0.13
264	601717	中创智领	13,200	183,612.00	0.13
265	002430	杭氧股份	5,900	182,664.00	0.13
266	300487	蓝晓科技	3,100	182,435.00	0.13
267	000032	深桑达 A	7,300	182,135.00	0.13
268	000415	渤海租赁	44,700	181,929.00	0.13
269	000683	博源化工	31,300	180,288.00	0.13
270	600863	华能蒙电	38,200	179,540.00	0.13
271	000039	中集集团	22,133	179,498.63	0.13
272	603444	吉比特	500	179,210.00	0.13
273	603766	隆鑫通用	15,000	178,950.00	0.13
274	600704	物产中大	37,900	178,888.00	0.13
275	601001	晋控煤业	10,200	177,378.00	0.13
276	601990	南京证券	26,800	176,076.00	0.13
277	688538	和辉光电	67,700	176,020.00	0.13
278	600873	梅花生物	23,900	175,665.00	0.13
279	600312	平高电气	9,900	174,834.00	0.13
280	603077	和邦生物	75,160	174,371.20	0.12
281	603605	珀莱雅	2,900	173,768.00	0.12
282	000050	深天马 A	17,500	173,425.00	0.12
283	002841	视源股份	5,000	172,650.00	0.12
284	600332	白云山	8,600	172,344.00	0.12
285	600765	中航重机	13,280	171,577.60	0.12
286	000729	燕京啤酒	16,900	171,197.00	0.12
287	688692	达梦数据	700	171,003.00	0.12

288	688297	中无人机	4,100	170,355.00	0.12
289	000887	中鼎股份	9,500	169,955.00	0.12
290	000967	盈峰环境	16,100	169,533.00	0.12
291	600348	华阳股份	22,050	168,682.50	0.12
292	600153	建发股份	21,200	168,116.00	0.12
293	600166	福田汽车	57,700	167,907.00	0.12
294	000830	鲁西化工	13,700	164,400.00	0.12
295	601611	中国核建	14,700	163,905.00	0.12
296	600901	江苏金租	28,300	162,725.00	0.12
297	688582	芯动联科	2,500	162,500.00	0.12
298	002410	广联达	19,900	162,384.00	0.12
299	002683	广东宏大	5,500	161,095.00	0.12
300	002939	长城证券	19,300	160,962.00	0.12
301	002007	华兰生物	13,100	159,689.00	0.11
302	000062	深圳华强	5,000	159,100.00	0.11
303	600737	中粮糖业	12,900	159,057.00	0.11
304	688615	合合信息	1,400	158,340.00	0.11
305	600578	京能电力	24,500	158,025.00	0.11
306	002926	华西证券	18,900	154,413.00	0.11
307	601799	星宇股份	1,700	154,054.00	0.11
308	600363	联创光电	4,300	153,854.00	0.11
309	603568	伟明环保	9,980	153,492.40	0.11
310	688114	华大智造	3,000	153,240.00	0.11
311	600398	海澜之家	29,300	153,239.00	0.11
312	000921	海信家电	5,600	152,992.00	0.11
313	603298	杭叉集团	6,400	152,704.00	0.11
314	603728	鸣志电器	2,500	152,300.00	0.11
315	000591	太阳能	32,900	151,340.00	0.11
316	000737	北方铜业	11,400	150,708.00	0.11
317	002603	以岭药业	10,000	150,000.00	0.11
318	600486	扬农化工	2,956	149,869.20	0.11
319	601000	唐山港	36,046	149,590.90	0.11
320	688248	南网科技	2,157	149,221.26	0.11
321	603341	龙旗科技	3,500	148,715.00	0.11
322	600316	洪都航空	5,300	148,082.00	0.11
323	000528	柳工	19,600	147,980.00	0.11
324	600208	衢州发展	51,900	146,877.00	0.11
325	600008	首创环保	53,720	146,118.40	0.10
326	000738	航发控制	7,900	144,491.00	0.10
327	600435	北方导航	12,900	144,480.00	0.10
328	600998	九州通	30,748	144,208.12	0.10
329	600170	上海建工	64,900	144,078.00	0.10
330	600995	南网储能	11,700	143,910.00	0.10

331	000932	华菱钢铁	41,280	143,241.60	0.10
332	603486	科沃斯	2,800	142,100.00	0.10
333	000987	越秀资本	18,030	140,994.60	0.10
334	600161	天坛生物	12,100	140,118.00	0.10
335	002152	广电运通	14,900	139,762.00	0.10
336	600820	隧道股份	26,800	139,628.00	0.10
337	000997	新大陆	8,519	138,859.70	0.10
338	600483	福能股份	13,600	138,584.00	0.10
339	601106	中国一重	41,900	138,270.00	0.10
340	603885	吉祥航空	13,400	137,886.00	0.10
341	600282	南钢股份	30,000	137,700.00	0.10
342	002262	恩华药业	7,300	136,875.00	0.10
343	000951	中国重汽	7,000	136,570.00	0.10
344	600583	海油工程	27,100	136,313.00	0.10
345	000009	中国宝安	21,780	135,689.40	0.10
346	688778	厦钨新能	2,488	135,347.20	0.10
347	603816	顾家家居	6,000	134,160.00	0.10
348	603939	益丰药房	7,424	133,483.52	0.10
349	002500	山西证券	25,790	133,076.40	0.10
350	600546	山煤国际	12,100	132,253.00	0.09
351	603338	浙江鼎力	3,100	131,750.00	0.09
352	600329	达仁堂	3,500	130,270.00	0.09
353	601666	平煤股份	18,200	130,130.00	0.09
354	600562	国睿科技	6,100	129,442.00	0.09
355	600763	通策医疗	3,803	128,845.64	0.09
356	000582	北部湾港	12,000	128,760.00	0.09
357	601567	三星电气	8,600	128,484.00	0.09
358	688295	中复神鹰	2,119	128,284.26	0.09
359	688166	博瑞医药	3,650	127,786.50	0.09
360	600685	中船防务	5,000	127,200.00	0.09
361	603565	中谷物流	12,900	126,549.00	0.09
362	600380	健康元	13,396	126,190.32	0.09
363	600038	中直股份	4,969	125,666.01	0.09
364	600602	云赛智联	7,800	125,424.00	0.09
365	600390	五矿资本	27,400	124,944.00	0.09
366	002312	川发龙蟒	13,600	124,712.00	0.09
367	601880	辽港股份	90,100	124,338.00	0.09
368	003022	联泓新科	4,800	124,320.00	0.09
369	601156	东航物流	7,700	124,124.00	0.09
370	000723	美锦能源	37,000	123,950.00	0.09
371	600132	重庆啤酒	3,000	123,900.00	0.09
372	601399	国机重装	35,200	123,200.00	0.09
373	000513	丽珠集团	4,253	122,869.17	0.09

374	300676	华大基因	3,500	122,710.00	0.09
375	688318	财富趋势	1,720	122,653.20	0.09
376	601865	福莱特	11,600	121,916.00	0.09
377	600535	天士力	9,200	121,716.00	0.09
378	688281	华秦科技	2,400	120,552.00	0.09
379	600511	国药股份	4,600	119,784.00	0.09
380	600977	中国电影	9,187	118,696.04	0.09
381	601236	红塔证券	17,400	118,668.00	0.09
382	600906	财达证券	15,900	118,614.00	0.09
383	600816	建元信托	48,200	117,608.00	0.08
384	000739	普洛药业	7,000	116,620.00	0.08
385	688336	三生国健	2,175	115,492.50	0.08
386	000598	兴蓉环境	17,900	114,918.00	0.08
387	600970	中材国际	16,100	114,793.00	0.08
388	002244	滨江集团	15,000	114,000.00	0.08
389	300100	双林股份	4,100	113,898.00	0.08
390	301666	大普微	244	113,052.52	0.08
391	601155	新城控股	11,000	112,860.00	0.08
392	002299	圣农发展	7,400	112,184.00	0.08
393	600967	内蒙一机	10,300	111,755.00	0.08
394	002120	韵达股份	17,400	110,664.00	0.08
395	300144	宋城演艺	19,000	110,390.00	0.08
396	300146	汤臣倍健	12,200	110,288.00	0.08
397	300718	长盛轴承	1,800	109,746.00	0.08
398	000883	湖北能源	25,400	109,728.00	0.08
399	300735	光弘科技	4,800	109,152.00	0.08
400	688278	特宝生物	1,964	106,841.60	0.08
401	002568	百润股份	6,300	106,596.00	0.08
402	600131	国网信通	7,300	106,580.00	0.08
403	000027	深圳能源	17,120	106,144.00	0.08
404	000800	一汽解放	17,800	105,910.00	0.08
405	601608	中信重工	22,200	105,894.00	0.08
406	603737	三棵树	4,367	105,244.70	0.08
407	003021	兆威机电	1,200	104,820.00	0.08
408	600095	湘财股份	13,900	104,667.00	0.08
409	601866	中远海发	47,300	104,533.00	0.07
410	688363	华熙生物	2,900	103,733.00	0.07
411	600801	华新建材	6,572	102,523.20	0.07
412	601118	海南橡胶	20,800	102,336.00	0.07
413	000088	盐田港	25,000	102,250.00	0.07
414	600754	锦江酒店	5,600	100,744.00	0.07
415	002583	海能达	13,100	100,739.00	0.07
416	600126	杭钢股份	16,430	100,715.90	0.07

417	600871	石化油服	49,300	100,079.00	0.07
418	600566	济川药业	4,500	99,855.00	0.07
419	603000	人民网	6,700	99,093.00	0.07
420	600517	国网英大	20,800	97,344.00	0.07
421	600655	豫园股份	23,600	96,996.00	0.07
422	002984	森麒麟	7,400	96,718.00	0.07
423	000709	河钢股份	49,400	95,836.00	0.07
424	603589	口子窖	5,100	95,268.00	0.07
425	603858	步长制药	6,500	94,900.00	0.07
426	600598	北大荒	8,700	94,308.00	0.07
427	601598	中国外运	18,900	93,744.00	0.07
428	000825	太钢不锈	27,300	93,093.00	0.07
429	603899	晨光股份	4,500	92,835.00	0.07
430	600350	山东高速	8,300	92,379.00	0.07
431	601966	玲珑轮胎	9,000	91,710.00	0.07
432	301606	绿联科技	1,500	91,530.00	0.07
433	002423	中粮资本	11,100	91,353.00	0.07
434	001286	陕西能源	9,000	91,260.00	0.07
435	600663	陆家嘴	14,500	91,060.00	0.07
436	600004	白云机场	12,500	90,750.00	0.07
437	002773	康弘药业	4,400	89,980.00	0.06
438	688349	三一重能	5,920	89,865.60	0.06
439	600582	天地科技	20,100	89,445.00	0.06
440	688709	成都华微	2,336	88,978.24	0.06
441	688192	迪哲医药	2,200	87,846.00	0.06
442	600848	上海临港	11,700	87,633.00	0.06
443	601098	中南传媒	8,800	86,592.00	0.06
444	000429	粤高速 A	6,300	85,995.00	0.06
445	603233	大参林	5,556	83,506.68	0.06
446	002508	老板电器	5,700	83,334.00	0.06
447	600062	华润双鹤	5,132	82,317.28	0.06
448	600968	海油发展	24,700	82,251.00	0.06
449	688563	航材股份	1,600	81,968.00	0.06
450	601928	凤凰传媒	9,300	81,747.00	0.06
451	003035	南网能源	13,700	79,734.00	0.06
452	688561	奇安信	3,300	79,134.00	0.06
453	601808	中海油服	7,300	78,913.00	0.06
454	600688	上海石化	26,900	78,817.00	0.06
455	688425	铁建重工	19,600	78,792.00	0.06
456	300957	贝泰妮	2,500	78,775.00	0.06
457	300888	稳健医疗	2,780	77,812.20	0.06
458	002670	国盛证券	7,036	77,396.00	0.06
459	600295	鄂尔多斯	7,200	77,184.00	0.06

460	688708	佳驰科技	1,500	76,200.00	0.05
461	600098	广州发展	12,800	75,648.00	0.05
462	002032	苏泊尔	1,900	75,240.00	0.05
463	688790	昂瑞微	580	73,341.00	0.05
464	000537	绿发电力	9,900	72,369.00	0.05
465	600808	马钢股份	28,936	72,340.00	0.05
466	000539	粤电力 A	10,600	72,186.00	0.05
467	600292	电投水电	5,900	71,036.00	0.05
468	002153	石基信息	9,720	70,275.60	0.05
469	600377	宁沪高速	6,000	69,420.00	0.05
470	601298	青岛港	8,600	69,230.00	0.05
471	603833	欧派家居	2,200	66,242.00	0.05
472	000959	首钢股份	18,600	65,286.00	0.05
473	002265	建设工业	3,700	64,380.00	0.05
474	301301	川宁生物	8,000	63,520.00	0.05
475	603529	爱玛科技	3,200	62,432.00	0.04
476	600606	绿地控股	51,500	62,315.00	0.04
477	002608	江苏国信	9,000	62,100.00	0.04
478	600032	浙江新能	8,800	62,040.00	0.04
479	688781	视涯科技	1,471	62,017.36	0.04
480	600339	中油工程	20,200	62,014.00	0.04
481	688520	神州细胞	1,800	61,578.00	0.04
482	603786	科博达	1,500	61,365.00	0.04
483	603658	安图生物	2,100	60,942.00	0.04
484	688808	联讯仪器	38	60,204.54	0.04
485	000785	居然智家	29,900	59,800.00	0.04
486	601139	深圳燃气	10,500	59,430.00	0.04
487	600764	中国海防	3,400	59,262.00	0.04
488	301498	乖宝宠物	1,400	56,826.00	0.04
489	001248	华润新能源	5,606	56,676.66	0.04
490	000937	冀中能源	13,970	55,600.60	0.04
491	300140	节能环境	11,100	55,167.00	0.04
492	688475	萤石网络	2,000	54,700.00	0.04
493	000898	鞍钢股份	29,000	54,230.00	0.04
494	603049	中策橡胶	1,200	53,772.00	0.04
495	603175	超颖电子	600	53,454.00	0.04
496	601228	广州港	18,200	51,324.00	0.04
497	601019	山东出版	7,600	48,640.00	0.03
498	002945	华林证券	3,300	44,319.00	0.03
499	601112	振石股份	2,400	43,752.00	0.03
500	600927	永安期货	3,500	43,575.00	0.03
501	002461	珠江啤酒	5,300	40,121.00	0.03
502	600299	安迪苏	4,900	38,465.00	0.03

503	688809	强一股份	61	38,003.00	0.03
504	688819	天能股份	1,600	35,520.00	0.03
505	688820	盛合晶微	236	33,391.64	0.02
506	688712	北芯生命	908	32,615.36	0.02
507	688797	臻宝科技	52	24,370.84	0.02
508	603092	德力佳	400	21,588.00	0.02
509	001221	悍高集团	521	20,954.62	0.02
510	001399	惠科股份	668	18,523.64	0.01
511	001386	马可波罗	1,300	18,408.00	0.01
512	001257	盛龙股份	642	13,315.08	0.01
513	301687	新广益	164	12,755.92	0.01
514	301531	春光集团	175	9,023.00	0.01
515	603459	红板科技	102	8,600.64	0.01
516	301696	三瑞智能	99	8,593.20	0.01
517	301669	高特电子	265	7,526.00	0.01
518	301599	理奇智能	193	6,266.71	0.00
519	301513	尚水智能	101	5,146.96	0.00
520	001365	天海电子	164	5,134.84	0.00
521	001393	维通利	116	4,522.84	0.00
522	301683	慧谷新材	37	4,505.49	0.00
523	603352	至信股份	66	1,684.32	0.00
524	001220	世盟股份	53	1,472.34	0.00
525	603293	埃泰克	30	1,017.90	0.00
526	001312	福恩股份	58	973.24	0.00
527	400174	中天 3	138,400	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	1,722,166.00	0.79
2	001309	德明利	1,280,727.00	0.59
3	300475	香农芯创	767,521.00	0.35
4	600105	永鼎股份	755,450.00	0.35
5	300666	江丰电子	714,055.00	0.33
6	300548	长芯博创	680,983.00	0.31
7	688037	芯源微	678,162.65	0.31
8	601869	长飞光纤	661,076.00	0.30
9	688313	仕佳光子	597,041.40	0.27
10	300620	光库科技	578,916.00	0.26
11	002407	多氟多	564,366.00	0.26
12	688200	华峰测控	510,195.38	0.23

13	600711	盛屯矿业	488,415.00	0.22
14	002812	恩捷股份	479,492.00	0.22
15	301200	大族数控	471,857.00	0.22
16	603256	宏和科技	467,490.00	0.21
17	301377	鼎泰高科	464,766.00	0.21
18	688281	华秦科技	459,613.03	0.21
19	300751	迈为股份	419,047.00	0.19
20	688411	海博思创	392,070.77	0.18

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	600487	亨通光电	2,295,997.00	1.05
2	301308	江波龙	2,074,792.00	0.95
3	002353	杰瑞股份	1,921,776.00	0.88
4	002156	通富微电	1,672,258.00	0.76
5	000657	中钨高新	1,557,429.00	0.71
6	000426	兴业银锡	1,539,409.00	0.70
7	002202	金风科技	1,459,839.00	0.67
8	002837	英维克	1,372,636.70	0.63
9	300450	先导智能	1,341,653.00	0.61
10	688525	佰维存储	1,229,902.00	0.56
11	000933	神火股份	1,167,219.00	0.53
12	300136	信维通信	1,130,759.00	0.52
13	002532	天山铝业	1,092,991.00	0.50
14	002558	巨人网络	1,062,662.00	0.49
15	300751	迈为股份	1,004,988.00	0.46
16	002080	中材科技	967,384.00	0.44
17	300604	长川科技	947,132.00	0.43
18	600549	厦门钨业	940,924.00	0.43
19	002595	豪迈科技	924,330.20	0.42
20	300058	蓝色光标	882,710.00	0.40

注：本项的“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	46,414,755.62
卖出股票收入（成交）总额	106,464,099.01

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	50,001.35	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	50,001.35	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	240	24,000.32	0.02
2	113704	春风转债	200	20,000.92	0.01
3	118071	华峰转债	60	6,000.11	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

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

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

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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

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没有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。

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

基金投资的前十名股票中，没有投资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	49,367.37
2	应收清算款	6,676.85
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	-
8	其他	-
9	合计	56,044.22

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

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

持有	户均持有的	持有人结构
----	-------	-------

人户数 (户)	基金份额	机构投资者		个人投资者		国寿安保中证 500 交易 型开放式指数证券投资 基金联接基金	
		持有份额	占总 份额 比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
336	185,472.28	3,845,378.00	6.17	1,850,923.00	2.97	56,622,386.00	90.86

8.2 盈利投资者数量占比

不适用。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 5 月 29 日）基金份额总额	665,869,631.00
本报告期期初基金份额总额	120,318,687.00
本报告期基金总申购份额	8,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	66,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	62,318,687.00

§ 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

本报告期内，基金管理人于 2026 年 6 月 23 日发布公告，刘忠江先生于 2026 年 6 月 22 日起任公司总经理，鄂华先生于 2026 年 6 月 22 日离任公司总经理；基金管理人于 2026 年 7 月 2 日发布公告，岳海先生于 2026 年 6 月 30 日离任公司总经理助理。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所，会计师事务所为毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人未受监管部门调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，管理人相关从业人员未受监管部门调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

无。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

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(%)	
中金公司	2	76,629,828.03	50.31	15,011.83	50.31	—
中信证券	2	75,684,577.44	49.69	14,825.52	49.69	—
国泰海通	4	—	—	—	—	—
国信证券	2	—	—	—	—	—
申万宏源	1	—	—	—	—	—
太平洋证券	1	—	—	—	—	—

兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-

注：根据中国证券监督管理委员会《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（证监会公告〔2024〕3号）相关规定，本公司制定了基金专用交易单元的选择标准和程序，具体如下：

1、关于基金专用交易单元的选择标准：

（1）综合实力较强，财务状况良好，具有较强研究实力，并能够第一时间提供丰富的高质量研究咨询报告，并能根据特定要求提供定制研究报告；能够积极同我公司进行业务交流，定期来我公司进行观点交流和路演（为被动股票型基金选择证券公司不适用该条）；

（2）市场信誉良好、经营状况稳健；

（3）经营行为规范，合规风控能力较强，具备健全的内部控制制度；

（4）交易能力较强，具有费率优势，具备支持交易的安全、稳定、便捷、高效的通讯条件和交易环境，能够提供全面的交易信息服务；

（5）从制度上和技术上保证我公司交易信息严格保密。

2、关于基金专用交易单元的选择程序：

（1）公司相关业务部门提出新增交易单元的需求，研究部根据公司《证券公司交易服务管理办法》的选择标准提出备选证券公司名单；

（2）备选的证券公司名单确定后，研究部会同投资相关部门组织证券公司就研究服务和佣金费率等展开评估，并对证券公司进行打分，最终按照综合分数排名情况确定入选的证券公司名单，合规管理部对谈判、打分及选择的过程进行合规性监督；

（3）入选证券公司名单确定后，研究部将全部协议内容以书面方式确定为合同文本，交由合规管理部审核后，与证券公司签署交易单元租用协议，协议约定双方的权利义务，明确服务内容、收取交易佣金的价格标准与计算方式。

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 (%)
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	75,154.07	100.00	-	-	-	-

国泰海通	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

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	国寿安保基金管理有限公司关于变更旗下部分上交所 ETF 扩位证券简称的公告	中证报、证监会规定网站及公司网站	2026 年 1 月 23 日
2	关于国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格波动的提示性公告	中证报、证监会规定网站及公司网站	2026 年 3 月 24 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
其他	1	20260101~20260630	116, 525, 786. 00	96, 600. 00	60, 000, 000. 00	56, 622, 386. 00	90. 86
产品特有风险							
本基金在报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情形，可能存在大额赎回的风险并导致基金净值波动。此外，机构投资者赎回后，可能导致基金规模大幅减小，不利于基金的正常运作。 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，并将采取有效措施保证中小投资者的合法权益。							

注：上述申购份额含交易所二级市场买入，赎回份额含交易所二级市场卖出。

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

12.1.1 中国证监会批准国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金募集

的文件

12.1.2 《国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

12.1.3 《国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照

12.1.5 报告期内国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金在指定媒体上披露的各项公告

12.1.6 中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

国寿安保基金管理有限公司，地址：北京市西城区金融大街 28 号院盈泰商务中心 2 号楼 11 层

12.3 查阅方式

12.3.1 营业时间内到本公司免费查阅

12.3.2 登录本公司网站查阅基金产品相关信息：www.gsfunds.com.cn

12.3.3 拨打本公司客户服务电话垂询：4009-258-258

国寿安保基金管理有限公司

2026 年 8 月 29 日