

汇安中证 A500 指数证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:汇安基金管理有限责任公司

基金托管人:中国光大银行股份有限公司

送出日期:2026 年 08 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国光大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、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2026年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
§4 管理人报告.....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
§5 托管人报告.....	16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	16
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	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 净资产变动表	20
6.4 报表附注	22
§7 投资组合报告.....	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	46
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.....	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	63
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	65
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.....	65
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	65
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	66
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.....	66
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	66
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	66
7.12 投资组合报告附注	66
§8 基金份额持有人信息.....	67

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	67
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	68
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.....	68
§9 开放式基金份额变动.....	68
§10 重大事件揭示	69
10.1 基金份额持有人大会决议	69
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.....	69
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	69
10.4 基金投资策略的改变	69
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	69
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	69
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.....	70
10.8 其他重大事件	71
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	72
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	72
§12 备查文件目录	72
12.1 备查文件目录	72
12.2 存放地点	73
12.3 查阅方式	73

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇安中证A500指数证券投资基金	
基金简称	汇安中证A500指数	
基金主代码	023038	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025年01月24日	
基金管理人	汇安基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	25,844,902.38份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇安中证A500指数A	汇安中证A500指数C
下属分级基金的交易代码	023038	023039
报告期末下属分级基金的份额总额	3,707,940.88份	22,136,961.50份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用被动式指数化投资策略，紧密跟踪中证A500指数，力求实现对标的指数的跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金投资策略主要包括股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资基金策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略等。
业绩比较基准	中证A500指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

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	汇安基金管理有限责任公司	中国光大银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	郭冬青	王茵
	联系电话	010-56711600	010-63639180
	电子邮箱	guodq@huianfund.cn	wangyin@cebbank.com
客户服务电话		010-56711690	95595
传真		010-56711640	010-63639132
注册地址		上海市虹口区欧阳路218弄1号2楼215室	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
办公地址		北京市东城区东直门南大街5号中青旅大厦13层；上海市虹口区东大名路501号白玉兰大厦36层	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码		100007	100033
法定代表人		刘强	吴利军

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.huianfund.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人办公地点

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	汇安基金管理有限责任公司	上海市虹口区东大名路501号上海白玉兰广场36层02单元

§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01月01日-2026年06月30日)
---------------	----------------------------------

	汇安中证A500指数 A	汇安中证A500指数 C
本期已实现收益	267,353.30	1,728,177.13
本期利润	595,867.69	3,132,692.70
加权平均基金份额本期利润	0.1586	0.1309
本期加权平均净值利润率	12.38%	10.25%
本期基金份额净值增长率	11.27%	11.13%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2026年06月30日)	
期末可供分配利润	729,958.16	4,257,172.71
期末可供分配基金份额利润	0.1969	0.1923
期末基金资产净值	5,046,264.69	30,018,597.99
期末基金份额净值	1.3609	1.3560
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2026年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	36.09%	35.60%

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

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

3、对期末可供分配利润，采用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余额的孰低数。

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

汇安中证A500指数A

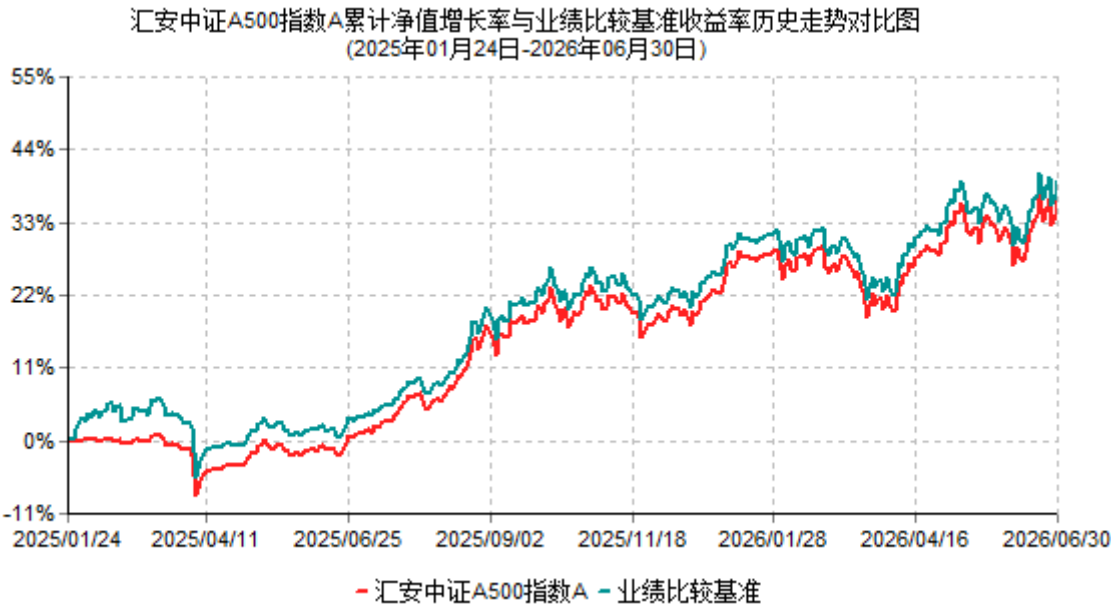
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	13.41%	1.31%	13.54%	1.34%	-0.13%	-0.03%

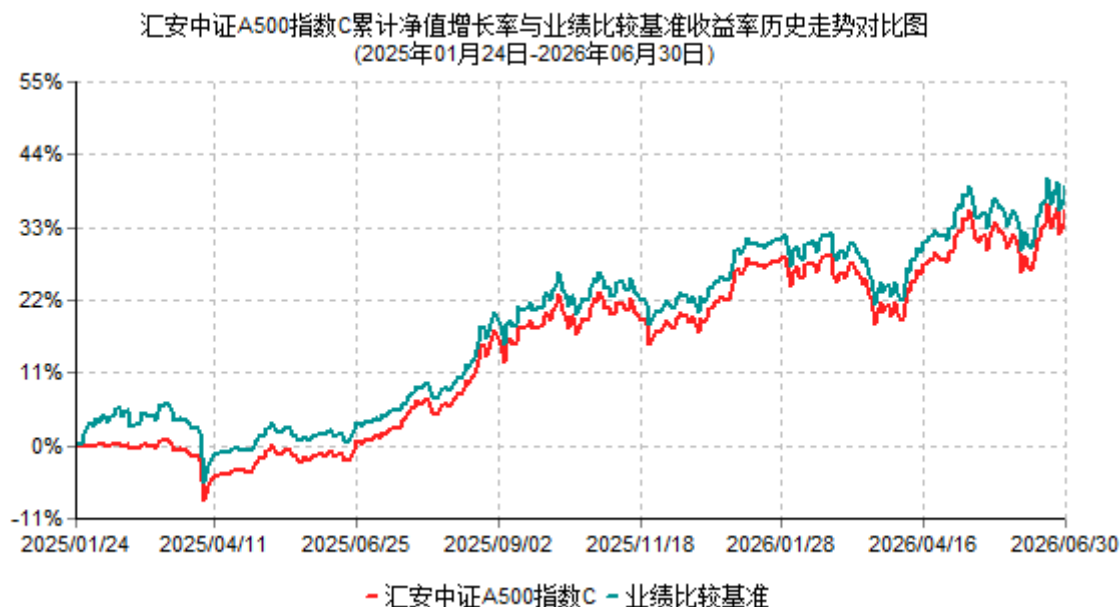
过去六个月	11.27%	1.21%	11.34%	1.22%	-0.07%	-0.01%
过去一年	34.69%	1.07%	34.41%	1.09%	0.28%	-0.02%
自基金合同生效起至今	36.09%	1.00%	39.21%	1.07%	-3.12%	-0.07%

汇安中证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	13.34%	1.31%	13.54%	1.34%	-0.20%	-0.03%
过去六个月	11.13%	1.21%	11.34%	1.22%	-0.21%	-0.01%
过去一年	34.35%	1.07%	34.41%	1.09%	-0.06%	-0.02%
自基金合同生效起至今	35.60%	1.00%	39.21%	1.07%	-3.61%	-0.07%

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





注：①基金合同生效日为2025年1月24日，至本报告期末，本基金合同生效已满一年。

②根据《汇安中证A500指数证券投资基金基金合同》的规定，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其备选成份股（含存托凭证，下同）、国内依法发行上市的股票（包含主板、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）、国内依法发行上市的债券（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债券、政府支持机构债券、政府支持债券等）、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）、货币市场工具、资产支持证券、国债期货、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）。本基金根据相关法律法规可以参与融资及转融通证券出借业务。基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%且不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计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、应收申购款等；股指期货、国债期货、股票期权及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。根据基金合同的规定，自基金合同生效之日起6个月内基金各项资产配置比例需符合基金合同要求。截至本报告期末，本基金已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年。本基金建仓期为2025年1月24日至2025年7月23日，建仓结束时各项资产比例符合合同约定。

§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

本基金管理人为汇安基金管理有限责任公司，于2016年4月19日获中国证监会批复，2016年4月25日正式成立，是业内首家全自然人、由内部核心专业人士控股的公募基金管理公司，注册资本1亿元人民币，注册地为上海市，设北京、上海双总部。公司目前具有公开募集证券投资基金管理、基金销售、特定客户资产管理的资格。

截至2026年6月30日，公司旗下管理71只公募基金：

汇安丰融灵活配置混合型证券投资基金
汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金
汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金
汇安嘉源纯债债券型证券投资基金
汇安丰利灵活配置混合型证券投资基金
汇安丰泽灵活配置混合型证券投资基金
汇安沪深300指数增强型证券投资基金
汇安嘉裕纯债债券型证券投资基金
汇安多策略灵活配置混合型证券投资基金
汇安资产轮动灵活配置混合型证券投资基金
汇安裕华纯债定期开放债券型发起式证券投资基金
汇安成长优选灵活配置混合型证券投资基金
汇安稳裕债券型证券投资基金
汇安趋势动力股票型证券投资基金
汇安量化优选灵活配置混合型证券投资基金
汇安裕阳三年持有期混合型证券投资基金
汇安短债债券型证券投资基金
汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金
富时中国A50交易型开放式指数证券投资基金
汇安核心成长混合型证券投资基金
汇安鼎利纯债债券型证券投资基金
汇安多因子混合型证券投资基金
汇安行业龙头混合型证券投资基金
汇安中短债债券型证券投资基金
汇安嘉诚债券型证券投资基金
汇安量化先锋混合型证券投资基金

汇安中债-广西壮族自治区公司信用类债券指数证券投资基金

汇安宜创量化精选混合型证券投资基金

汇安嘉盛纯债债券型证券投资基金

汇安信利债券型证券投资基金

汇安裕和纯债债券型证券投资基金

汇安上证证券交易型开放式指数证券投资基金

汇安嘉利混合型证券投资基金

汇安核心资产混合型证券投资基金

汇安裕鑫12个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金

汇安价值蓝筹混合型证券投资基金

汇安消费龙头混合型证券投资基金

汇安恒鑫12个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金

汇安中证500指数增强型证券投资基金

汇安泓阳三年持有期混合型证券投资基金

汇安恒利39个月定期开放纯债债券型证券投资基金

汇安盛鑫三年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金

汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金

汇安均衡优选混合型证券投资基金

汇安核心价值混合型证券投资基金

汇安鑫利优选混合型证券投资基金

汇安泓利一年持有期混合型证券投资基金

汇安鑫泽稳健一年持有期混合型证券投资基金

汇安信泰稳健一年持有期混合型证券投资基金

汇安优势企业精选混合型证券投资基金

汇安永利30天持有期短债债券型证券投资基金

汇安润阳三年持有期混合型证券投资基金

汇安永福90天持有期中短债债券型证券投资基金

汇安裕同纯债债券型证券投资基金

汇安添利18个月持有期混合型证券投资基金

汇安远见成长混合型证券投资基金

汇安品质优选混合型证券投资基金

汇安价值先锋混合型证券投资基金

汇安裕盈纯债债券型证券投资基金

汇安裕泰纯债债券型证券投资基金

汇安中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金

汇安均衡成长混合型证券投资基金
汇安行业优选混合型证券投资基金
汇安中债0-3年政策性金融债指数证券投资基金
汇安景气成长混合型证券投资基金
汇安中证A500指数证券投资基金
汇安裕宏利率债债券型证券投资基金
汇安聚利债券型证券投资基金
汇安质选增利债券型证券投资基金
汇安中证红利低波动100指数型证券投资基金
汇安成长领航混合型证券投资基金

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金 经理（助理） 期限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
陈思余	策略量化组基金经 理、本基金的基金经 理	2025- 01-24	-	9年	陈思余先生，南开大学信息 安全与法学双学位学士，9 年证券、基金行业从业经 验。历任天源迪科信息技术 股份有限公司计费产品一 部JAVA开发工程师。2017 年4月加入汇安基金管理有 限责任公司，担任策略量化 组基金经理。2023年10月2 5日至2024年11月14日，任 汇安量化先锋混合型证券 投资基金基金经理；2023年 10月25日至今，任汇安上证 证券交易型开放式指数证 券投资基金基金经理；202 3年10月25日至今，任富时 中国A50交易型开放式指数

					证券投资基金基金经理；2025年1月24日至今，任汇安中证A500指数证券投资基金基金经理；2025年10月10日至今，任汇安趋势动力股票型证券投资基金基金经理；2025年12月22日至今，任汇安核心成长混合型证券投资基金基金经理；2026年1月29日至今，任汇安资产轮动灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

1、上述任职日期、离职日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

2、本基金无基金经理助理。

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

本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

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》等有关法律法规的规定及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的约定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无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，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，完善相应制度及流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，确保公平交易原则的实现。基金管理人公平对待旗下管理的所有投资组合，报告期内公平交易制度得到良好的贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的情况。

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同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

基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。本报告期内，本基金未发现可能的异常交易情况，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成交量超过该证券当日成交量的5%的情况。

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

国内方面，2026年上半年经济总体延续温和修复，工业生产、高端制造和出口保持韧性，消费与房地产修复相对偏缓，经济结构持续由传统动能向科技创新和先进制造切换。政策层面对科技的重视进一步提升，人工智能、集成电路、机器人、高端装备等新质生产力方向获得更多支持，资本、场景和产业链资源加快向关键核心技术领域集中，为半导体存储、国产GPU及科技成长板块提供了较为明确的中长期产业基础。

海外方面，2026年上半年全球市场主要受到美联储政策路径、美伊冲突及能源价格波动影响。美伊冲突抬升了中东原油供应与航运风险，油价上涨通过通胀预期和利率路径影响全球资产定价；同时，原油以美元计价结算的石油美元体系强化了油价、美元和全球流动性之间的联动。短期看，冲突有利于原油、黄金等避险和资源资产，但在未来可能对高估值成长股形成阶段性压制；中长期看，海外科技竞争和产业链限制或将进一步强化国内科技自主可控和国产替代逻辑。

中证A500指数凭借覆盖行业广、成长属性突出、行业分布均衡等优势，较好地反映了我国经济结构升级和产业转型的发展方向。指数兼顾传统优势行业与战略性新兴产业，在保持行业均衡配置的同时，较高比例布局新质生产力相关领域，为投资者分享中国经济高质量发展成果提供了较好的投资工具。

作为被动指数基金，本基金保持指数化被动投资策略，积极降低基金的跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末汇安中证A500指数A基金份额净值为1.3609元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为11.27%，同期业绩比较基准收益率为11.34%；截至报告期末汇安中证A500指数C基金份额净值为1.3560元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为11.13%，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

展望2026年下半年，国内经济有望延续温和修复态势，积极财政政策与适度宽松货币政策将继续有力支持科技创新和新质生产力发展，高端制造、人工智能等领域仍将是

经济增长的重要动能之一。海外方面，美联储货币政策、地缘政治及能源价格波动等仍将影响全球流动性和市场风险偏好，但也将进一步强化我国科技自主可控和国产替代的发展逻辑。总体来看，市场结构性机会依然存在，我们将持续看好代表新质生产力的A500指数的长期投资机会。

在稳增长政策持续发力、科技创新不断推进的背景下，经济增长动能依然将会进一步向先进制造、数字经济、人工智能、高端装备等领域集中，指数成分股整体盈利能力预计将继续改善。中证A500指数作为兼具成长性与代表性的核心宽基指数，长期配置价值将进一步显现。投资策略上，我们继续看好中国经济高质量发展背景下核心资产的长期投资机会，重点关注受益于产业升级、科技创新和消费升级的优质上市公司。通过配置中证A500指数，一方面分享我国经济转型升级带来的长期成长红利，另一方面借助指数较好的行业分散度和代表性，提升组合配置效率，在控制组合风险的基础上努力获取长期稳健回报。

本基金管理人将紧密跟踪中证A500指数，跟踪偏离度与跟踪误差将努力控制在合理区间。我们将持续纪律化基金运作，兼顾流动性与成本控制的同时，争取与投资者共同分享中国经济高质量发展的成果。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，公司运营总监担任估值委员会主席，投资部门、合规风控部和运营部指定人员担任委员。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，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及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所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

本基金本报告期内未发生利润分配情况。

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

截至报告期末，本基金连续超过六十个工作日基金资产净值低于五千万元，本基金管理人已按法规要求向证监会报送解决方案。本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。为减轻基金固定费用支出给投资者造成的负担，切实保障基金份额持有人利益，2025年10月25日至本报告期末由基金管理人承担本基金相关固定费用（包括审计费、信息披露费等）。

§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，中国光大银行股份有限公司在汇安中证A500指数证券投资基金（以下简称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面的运作严格依据基金合同的约定进行。

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

中国光大银行股份有限公司以自身能够获取的数据和信息为限，根据法律法规规定、基金合同和托管协议约定对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进行了复核，认为以上内容真实、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：汇安中证A500指数证券投资基金

报告截止日：2026年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	2,090,858.01	2,515,437.64
结算备付金		1,133.05	190.62
存出保证金		4,733.59	23,681.55
交易性金融资产	6.4.7.2	33,081,578.46	34,335,491.93
其中：股票投资		33,081,578.46	34,335,491.93
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券 投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	315,728.90
应收股利		-	-
应收申购款		38,690.92	29,884.56
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		35,216,994.03	37,220,415.20
负 债 和 净 资 产	附注号	本期末 2026年06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		-	-
应付赎回款		127,725.49	754,526.93
应付管理人报酬		14,037.44	16,135.89
应付托管费		2,807.49	3,227.18
应付销售服务费		6,059.20	6,636.86
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	6.4.7.6	1,501.73	157,738.74
负债合计		152,131.35	938,265.60
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	25,844,902.38	29,720,580.46
未分配利润	6.4.7.8	9,219,960.30	6,561,569.14
净资产合计		35,064,862.68	36,282,149.60
负债和净资产总计		35,216,994.03	37,220,415.20

注：报告截止日2026年6月30日，基金份额总额25,844,902.38份，其中汇安中证A500指数A基金份额净值1.3609元，份额总额3,707,940.88份；汇安中证A500指数C基金份额净值1.3560元，份额总额22,136,961.50份。

6.2 利润表

会计主体：汇安中证A500指数证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月24日（基金 合同生效日）至2025年 06月30日
一、营业总收入		3,871,648.34	1,493,168.22
1.利息收入		3,989.70	200,682.44
其中：存款利息收入	6.4.7.9	3,989.70	137,069.87

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		-	63,612.57
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,131,290.03	902,195.50
其中：股票投资收益	6.4.7.10	1,846,431.79	-53,662.02
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	284,858.24	955,857.52
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	1,733,029.96	390,286.74
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	3,338.65	3.54
减：二、营业总支出		143,087.95	555,074.82
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	87,666.03	276,404.46
2.托管费	6.4.10.2.2	17,533.18	55,280.94
3.销售服务费	6.4.10.2.3	37,888.74	130,591.02
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		-	-

7.税金及附加		-	-
8.其他费用	6.4.7.18	-	92,798.40
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,728,560.39	938,093.40
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,728,560.39	938,093.40
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		3,728,560.39	938,093.40

6.3 净资产变动表

会计主体：汇安中证A500指数证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2026年01月01日至2026年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	29,720,580.46	6,561,569.14	36,282,149.60
二、本期期初净资产	29,720,580.46	6,561,569.14	36,282,149.60
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3,875,678.08	2,658,391.16	-1,217,286.92
（一）、综合收益总额	-	3,728,560.39	3,728,560.39
（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）	-3,875,678.08	-1,070,169.23	-4,945,847.31

其中：1.基金申购款	10,241,456.74	2,922,199.56	13,163,656.30
2.基金赎回款	-14,117,134.82	-3,992,368.79	-18,109,503.61
（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、本期期末净资产	25,844,902.38	9,219,960.30	35,064,862.68
项 目	上年度可比期间 2025年01月24日（基金合同生效日）至2025年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	222,952,890.05	-	222,952,890.05
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-137,100,731.90	801,498.44	-136,299,233.46
（一）、综合收益总额	-	938,093.40	938,093.40
（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）	-137,100,731.90	-136,594.96	-137,237,326.86
其中：1.基金申购款	6,669,305.63	-31,798.73	6,637,506.90
2.基金赎回款	-143,770,037.53	-104,796.23	-143,874,833.76
（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、本期期末净资产	85,852,158.15	801,498.44	86,653,656.59

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:

刘强	王嘉浩	江士
_____	_____	_____
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

汇安中证A500指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2024]1811号《关于准予汇安中证A500指数证券投资基金注册的批复》注册，由汇安基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇安中证A500指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，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222,905,833.65元，业经容诚会计师事务所(特殊普通合伙)容诚验字[2025]200Z0019号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《汇安中证A500指数证券投资基金基金合同》于2025年1月24日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额222,952,890.05份基金份额，其中认购资金利息折合47,056.40份基金份额。本基金的基金管理人为汇安基金管理有限责任公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《汇安中证A500指数证券投资基金基金合同》和《汇安中证A500指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据认购费/申购费及销售服务费收取方式的不同将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购基金时收取认购/申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，并不再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；在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费，并在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为C类基金份额。本基金A类和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间的转换规定请见相关公告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇安中证A500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具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成

份股及其备选成份股（含存托凭证，下同）、国内依法发行上市的股票（包含主板、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）、国内依法发行上市的债券（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债券、政府支持机构债券、政府支持债券等）、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）、货币市场工具、资产支持证券、国债期货、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）。本基金根据相关法律法规可以参与融资及转融通证券出借业务。本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90% 且不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计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、应收申购款等；股指期货、国债期货、股票期权及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：中证 A500 指数收益率 $\times 95\%$ + 银行活期存款利率（税后） $\times 5\%$ 。

本财务报表由本基金的基金管理人汇安基金管理有限责任公司于 2026 年 8 月 27 日批准报出。

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”）发布的中国证监会颁布的《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》、《汇安中证 A500 指数证券投资基金基金合同》和中国证监会、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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2026 年 6 月 30 日，本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案，故本财务报表仍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2026年6月30日的财务状况以及2026年1月1日至2026年6月30日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、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]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》、国务院令第826号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告2026年第10号《财政部 税务总局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) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。2027年12月31日前，资管产品管理人运营契约制资管产品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%的征收率缴纳增值税。

2027年12月31日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
活期存款	2,090,858.01
等于：本金	2,090,667.33
加：应计利息	190.68
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	2,090,858.01

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		26,746,410.46	-	33,081,578.46	6,335,168.00
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		26,746,410.46	-	33,081,578.46	6,335,168.00

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06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	1,501.73
其中：交易所市场	1,501.73
银行间市场	-
应付利息	-
合计	1,501.73

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 汇安中证A500指数A

金额单位：人民币元

项目 (汇安中证A500指数A)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,505,009.29	5,505,009.29
本期申购	2,965,671.19	2,965,671.19
本期赎回（以“-”号填列）	-4,762,739.60	-4,762,739.60
本期末	3,707,940.88	3,707,940.88

6.4.7.7.2 汇安中证A500指数C

金额单位：人民币元

项目 (汇安中证A500指数C)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	24,215,571.17	24,215,571.17

本期申购	7,275,785.55	7,275,785.55
本期赎回（以“-”号填列）	-9,354,395.22	-9,354,395.22
本期末	22,136,961.50	22,136,961.50

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 汇安中证A500指数A

单位：人民币元

项目 (汇安中证A500指数A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	671,947.67	556,251.06	1,228,198.73
本期期初	671,947.67	556,251.06	1,228,198.73
本期利润	267,353.30	328,514.39	595,867.69
本期基金份额交易产生的变动数	-209,342.81	-276,399.80	-485,742.61
其中：基金申购款	457,738.13	380,718.91	838,457.04
基金赎回款	-667,080.94	-657,118.71	-1,324,199.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	729,958.16	608,365.65	1,338,323.81

6.4.7.8.2 汇安中证A500指数C

单位：人民币元

项目 (汇安中证A500指数C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,889,936.29	2,443,434.12	5,333,370.41
本期期初	2,889,936.29	2,443,434.12	5,333,370.41
本期利润	1,728,177.13	1,404,515.57	3,132,692.70
本期基金份额交易产生的变动数	-360,940.71	-223,485.91	-584,426.62
其中：基金申购款	1,064,258.80	1,019,483.72	2,083,742.52
基金赎回款	-1,425,199.51	-1,242,969.63	-2,668,169.14
本期已分配利润	-	-	-

本期末	4,257,172.71	3,624,463.78	7,881,636.49
-----	--------------	--------------	--------------

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
活期存款利息收入	3,961.93
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	9.84
其他	17.93
合计	3,989.70

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 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01月01日至2026年06月30日
卖出股票成交总额	10,280,171.65
减：卖出股票成本总额	8,424,669.55
减：交易费用	9,070.31
买卖股票差价收入	1,846,431.79

6.4.7.10.2 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.12 资产支持证券投资基金收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资基金收益项目构成

无。

6.4.7.12.2 资产支持证券投资基金收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.12.3 资产支持证券投资基金收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.12.4 资产支持证券投资基金收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13 贵金属投资收益

6.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	284,858.24
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	284,858.24

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
1.交易性金融资产	1,733,029.96
——股票投资	1,733,029.96
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——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	1,733,029.96

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
基金赎回费收入	3,338.65
合计	3,338.65

6.4.7.18 其他费用

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

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

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
汇安基金管理有限责任公司	基金管理人、基金登记机构、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
何斌	基金管理人的股东
秦军	基金管理人的股东
郭小峰	基金管理人的股东
任建辉	基金管理人的股东
刘强	基金管理人的股东
郭兆强	基金管理人的股东
尹喜杰	基金管理人的股东
王福德	基金管理人的股东

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

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日 至2026年06月30 日	上年度可比期间 2025年01月24日（基金合同 生效日）至2025年06月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	87,666.03	276,404.46
其中：应支付销售机构的客户维护费	41,641.13	138,167.42
应支付基金管理人的净管理费	46,024.90	138,237.04

注：支付基金管理人汇安基金管理有限责任公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.50%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：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值 X 0.50% / 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01月01日 至2026年06月30 日	上年度可比期间 2025年01月24日（基金合同生 效日）至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	17,533.18	55,280.94

注：支付基金托管人中国光大银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.10%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：
日托管费＝前一日基金资产净值 X 0.10% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇安中证A500指数A	汇安中证A500指数C	合计
汇安基金 管理有限 责任公司	0.00	1,386.71	1,386.71
中国光大 银行股份 有限公司	0.00	33,919.02	33,919.02
合计	-	35,305.73	35,305.73
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2025年01月24日（基金合同生效日）至2025年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇安中证A500指数A	汇安中证A500指数C	合计
中国光大 银行股份 有限公司	0.00	130,391.99	130,391.99
合计	-	130,391.99	130,391.99

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0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给汇安基金管理有限责任公司，再由汇安基金管理有限责任公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费=前一日C类基金份额的基金资产净值× 0.25% / 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

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

汇安中证A500指数C

份额单位：份

项目	本期 2026年01月01 日至2026年06 月30日	上年度可比期间 2025年01月24日（基金 合同生效日）至2025年0 6月30日
基金合同生效日（2025年01月24日）持有的 基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	876,438.09	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	876,438.09	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比 例	3.96%	-

注：

1.基金管理人汇安基金管理有限责任公司投资本基金适用的认（申）购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

2.报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例，比例的分母分别采用各自类别的份额总额计算。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年01月24日（基金合同生效日） 至2025年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国光大银行股份有限公司	2,090,858.01	3,961.93	9,060,374.45	116,430.83

注：本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行股份有限公司保管，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

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于本报告期内，基金管理人自主承担本基金部分信息披露费和审计费等固定费用。（上年度对比期间：无。）

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

无。

6.4.12 期末（2026年06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

无。

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	2026-06-29	拟筹划重大资产重组	879.53	2026-07-13	890.99	200	34,146.00	175,906.00	-

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，其风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。

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，通过管理及信息系统持续监控上述各类风险。

公司建立董事会领导下的风险管理体系，包括董事会的下设的风险控制委员会、总经理下设的风险管理委员会、督察长、合规风控部以及各个业务部门组成。

公司致力于实行全面、系统的风险管理，通过制定系统化的风险管理程序，对风险管理的整个流程进行评估和改进。公司奉行分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，构建由四大防线共同筑成的风险管理体系：第一道防线由各个业务部门构成，各业务部门总监作为风险责任人；第二道监控防线由合规风控部构成，对公司运营过程中产生的或潜在的各项风险进行有效管理，并就内部控制及风险管理制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能；第三道防线是由总经理及其下设的风险管理委员会构成，总经理负责公司日常经营管理中的风险管理工作。总经理下设风险管理委员会，负责对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和防控；第四道监控防线由董事会及其下设公司风险控制委员会构成。董事会负责公司整体风险的预防和控制，审核、监督公司风险管理制度的有效执行。董事会下设公司风险控制委员会，协助董事会确立公司风险取向，风险总量、风险限额，制定和调整公司风险管理战略、原则、政策和指导方针，并确保其得到有效执行。

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，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国光大银行股份有限公司，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。

于2026年6月30日，本基金无债券投资或资产支持证券投资(2025年12月31日：同)。

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

无。

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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10% (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，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。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%。

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06月30日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026年 06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	2,090,858.01	-	-	-	2,090,858.01
结算备付金	1,133.05	-	-	-	1,133.05
存出保证金	4,733.59	-	-	-	4,733.59
交易性金融资产	-	-	-	33,081,578.46	33,081,578.46
应收申	-	-	-	38,690.92	38,690.92

购款					
资产总计	2,096,724.65	-	-	33,120,269.38	35,216,994.03
负债					
应付赎回款	-	-	-	127,725.49	127,725.49
应付管理人报酬	-	-	-	14,037.44	14,037.44
应付托管费	-	-	-	2,807.49	2,807.49
应付销售服务费	-	-	-	6,059.20	6,059.20
其他负债	-	-	-	1,501.73	1,501.73
负债总计	-	-	-	152,131.35	152,131.35
利率敏感度缺口	2,096,724.65	-	-	32,968,138.03	35,064,862.68
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	2,515,437.64	-	-	-	2,515,437.64
结算备付金	190.62	-	-	-	190.62
存出保	23,681.55	-	-	-	23,681.55

证金					
交易性 金融资产	-	-	-	34,335,491.93	34,335,491.93
应收清 算款	-	-	-	315,728.90	315,728.90
应收申 购款	-	-	-	29,884.56	29,884.56
资产总 计	2,539,309.81	-	-	34,681,105.39	37,220,415.20
负债					
应付赎 回款	-	-	-	754,526.93	754,526.93
应付管 理人报 酬	-	-	-	16,135.89	16,135.89
应付托 管费	-	-	-	3,227.18	3,227.18
应付销 售服务 费	-	-	-	6,636.86	6,636.86
其他负 债	-	-	-	157,738.74	157,738.74
负债总 计	-	-	-	938,265.60	938,265.60
利率敏 感度缺 口	2,539,309.81	-	-	33,742,839.79	36,282,149.60

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6月30日，本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资(2025年12月31日：同)，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。

本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数成分股组成及其权重构建投资组合，并根据标的指数成分股及其权重的变动进行相应调整。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中投资于标的指数成分股和备选成分股的比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，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06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	33,081,578.46	94.34	34,335,491.93	94.63
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	33,081,578.46	94.34	34,335,491.93	94.63

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证A500指数以外的其他变量保持不变		
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06月30日	上年度末 2025年12月31日
	中证A500指数上升5%	1,987,852.68	1,862,019.71
	中证A500指数下降5%	-1,987,852.68	-1,862,019.71

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06月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	32,905,672.46	34,097,299.73
第二层次	175,906.00	238,192.20
第三层次	-	-
合计	33,081,578.46	34,335,491.93

6.4.14.2 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6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	33,081,578.46	93.94
	其中：股票	33,081,578.46	93.94
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-

6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,091,991.06	5.94
8	其他各项资产	43,424.51	0.12
9	合计	35,216,994.03	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	105,783.00	0.30
B	采矿业	1,337,343.30	3.81
C	制造业	23,415,726.00	66.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	718,875.00	2.05
E	建筑业	429,708.00	1.23
F	批发和零售业	270,465.00	0.77
G	交通运输、仓储和邮政业	765,668.00	2.18
H	住宿和餐饮业	19,530.00	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,844,636.56	5.26
J	金融业	3,106,414.00	8.86
K	房地产业	192,038.00	0.55
L	租赁和商务服务业	246,482.00	0.70
M	科学研究和技术服务业	397,806.00	1.13
N	水利、环境和公共设施管理业	62,157.60	0.18
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	10,080.00	0.03
Q	卫生和社会工作	72,780.00	0.21

R	文化、体育和娱乐业	27,674.00	0.08
S	综合	58,412.00	0.17
	合计	33,081,578.46	94.34

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

7.2.3 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

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	1,100	1,397,000.00	3.98
2	300750	宁德时代	2,500	982,525.00	2.80
3	300502	新易盛	1,344	815,808.00	2.33
4	600519	贵州茅台	600	711,294.00	2.03
5	601318	中国平安	10,300	491,722.00	1.40
6	603986	兆易创新	600	489,000.00	1.39
7	688256	寒武纪	298	475,473.90	1.36
8	600036	招商银行	11,900	422,450.00	1.20
9	601899	紫金矿业	15,900	399,726.00	1.14
10	688498	源杰科技	200	377,200.00	1.08
11	688008	澜起科技	1,216	376,838.40	1.07
12	688041	海光信息	998	369,559.40	1.05
13	000333	美的集团	4,700	354,991.00	1.01
14	002475	立讯精密	4,900	344,960.00	0.98
15	002371	北方华创	385	340,555.60	0.97
16	002384	东山精密	1,200	314,820.00	0.90

17	600900	长江电力	11,800	312,346.00	0.89
18	688012	中微公司	663	310,615.50	0.89
19	688981	中芯国际	1,925	305,728.50	0.87
20	000725	京东方 A	35,000	303,800.00	0.87
21	603259	药明康德	2,400	298,824.00	0.85
22	600030	中信证券	9,400	270,062.00	0.77
23	601166	兴业银行	16,300	269,928.00	0.77
24	300059	东方财富	12,200	248,636.00	0.71
25	600183	生益科技	1,400	242,760.00	0.69
26	600276	恒瑞医药	4,300	223,772.00	0.64
27	300274	阳光电源	1,400	222,628.00	0.63
28	601398	工商银行	31,200	220,584.00	0.63
29	300408	三环集团	1,300	216,970.00	0.62
30	300476	胜宏科技	600	207,858.00	0.59
31	600487	亨通光电	1,900	207,746.00	0.59
32	002594	比亚迪	2,600	207,220.00	0.59
33	002463	沪电股份	1,300	198,640.00	0.57
34	601211	国泰海通	10,900	198,380.00	0.57
35	688525	佰维存储	400	197,892.00	0.56
36	300394	天孚通信	644	194,925.92	0.56
37	000988	华工科技	1,000	184,610.00	0.53
38	688072	拓荆科技	200	175,906.00	0.50
39	601288	农业银行	27,700	168,139.00	0.48
40	600176	中国巨石	2,300	167,624.00	0.48
41	601328	交通银行	25,700	165,251.00	0.47
42	000651	格力电器	4,300	161,250.00	0.46
43	600522	中天科技	2,600	157,768.00	0.45
44	603993	洛阳钼业	8,700	152,685.00	0.44
45	603019	中科曙光	1,400	150,122.00	0.43
46	688521	芯原股份	400	148,456.00	0.42
47	600150	中国船舶	4,344	146,783.76	0.42

48	600887	伊利股份	6,100	146,156.00	0.42
49	600584	长电科技	1,400	144,970.00	0.41
50	000338	潍柴动力	5,200	141,700.00	0.40
51	301308	江波龙	200	140,760.00	0.40
52	000858	五 粮 液	1,900	140,600.00	0.40
53	300604	长川科技	400	136,568.00	0.39
54	688347	华虹宏力	400	134,520.00	0.38
55	688120	华海清科	412	132,738.16	0.38
56	002281	光迅科技	500	128,470.00	0.37
57	601816	京沪高铁	28,300	128,199.00	0.37
58	002415	海康威视	3,700	126,540.00	0.36
59	300124	汇川技术	1,900	126,027.00	0.36
60	600309	万华化学	1,800	123,138.00	0.35
61	600111	北方稀土	2,500	120,125.00	0.34
62	002008	大族激光	800	120,088.00	0.34
63	000100	TCL科技	20,000	116,400.00	0.33
64	000063	中兴通讯	3,100	112,189.00	0.32
65	600089	特变电工	4,900	110,250.00	0.31
66	600000	浦发银行	12,800	110,208.00	0.31
67	002916	深南电路	240	109,896.00	0.31
68	300136	信维通信	900	107,325.00	0.31
69	300433	蓝思科技	2,000	107,320.00	0.31
70	601857	中国石油	12,000	104,160.00	0.30
71	002028	思源电气	600	103,800.00	0.30
72	600031	三一重工	6,000	103,680.00	0.30
73	300857	协创数据	300	101,970.00	0.29
74	601088	中国神华	2,600	101,504.00	0.29
75	300223	君正股份	400	99,560.00	0.28
76	300014	亿纬锂能	1,500	97,545.00	0.28
77	002050	三花智控	2,200	96,426.00	0.27
78	002714	牧原股份	2,700	94,473.00	0.27

79	601601	中国太保	3,300	94,116.00	0.27
80	600549	厦门钨业	1,100	93,720.00	0.27
81	600406	国电南瑞	4,100	93,685.00	0.27
82	000792	盐湖股份	3,100	93,589.00	0.27
83	000001	平安银行	9,300	93,465.00	0.27
84	002353	杰瑞股份	600	91,500.00	0.26
85	601668	中国建筑	21,000	91,140.00	0.26
86	002156	通富微电	1,200	91,044.00	0.26
87	300475	香农芯创	300	90,000.00	0.26
88	002436	兴森科技	1,700	86,615.00	0.25
89	000657	中钨高新	900	86,148.00	0.25
90	601919	中远海控	6,400	84,864.00	0.24
91	300054	鼎龙股份	800	84,776.00	0.24
92	688017	绿的谐波	200	83,572.00	0.24
93	601728	中国电信	15,900	82,521.00	0.24
94	300760	迈瑞医疗	600	81,498.00	0.23
95	601012	隆基绿能	6,200	81,344.00	0.23
96	600660	福耀玻璃	1,600	80,704.00	0.23
97	002602	世纪华通	5,700	80,370.00	0.23
98	600690	海尔智家	3,900	79,599.00	0.23
99	601988	中国银行	13,800	78,936.00	0.23
100	688777	中控技术	668	78,490.00	0.22
101	002230	科大讯飞	1,900	77,596.00	0.22
102	600941	中国移动	900	77,517.00	0.22
103	603501	豪威集团	800	75,880.00	0.22
104	601225	陕西煤业	3,700	75,295.00	0.21
105	002352	顺丰控股	2,400	75,024.00	0.21
106	601985	中国核电	8,200	74,046.00	0.21
107	002938	鹏鼎控股	700	73,766.00	0.21
108	603799	华友钴业	1,500	72,390.00	0.21
109	002709	天赐材料	1,400	72,002.00	0.21

110	002460	赣锋锂业	1,100	71,940.00	0.21
111	300346	南大光电	760	70,414.00	0.20
112	000977	浪潮信息	1,000	70,000.00	0.20
113	600160	巨化股份	1,300	68,913.00	0.20
114	300033	同花顺	280	67,480.00	0.19
115	000425	徐工机械	8,300	67,147.00	0.19
116	002851	麦格米特	400	66,872.00	0.19
117	688126	沪硅产业	1,671	66,656.19	0.19
118	300442	润泽科技	800	66,456.00	0.19
119	600460	士兰微	1,200	65,592.00	0.19
120	600938	中国海油	2,400	65,160.00	0.19
121	600028	中国石化	14,600	65,116.00	0.19
122	601600	中国铝业	7,900	64,938.00	0.19
123	300567	精测电子	200	63,520.00	0.18
124	601766	中国中车	12,200	63,440.00	0.18
125	002202	金风科技	2,600	62,140.00	0.18
126	002049	紫光国微	700	62,125.00	0.18
127	002837	英维克	780	62,056.80	0.18
128	300757	罗博特科	100	61,900.00	0.18
129	688002	睿创微纳	400	61,876.00	0.18
130	002466	天齐锂业	1,000	61,320.00	0.17
131	002600	领益智造	3,500	60,690.00	0.17
132	000938	紫光股份	2,100	60,606.00	0.17
133	600050	中国联通	15,100	60,400.00	0.17
134	002138	顺络电子	800	58,480.00	0.17
135	002185	华天科技	2,600	58,006.00	0.17
136	600879	航天电子	2,700	57,483.00	0.16
137	601628	中国人寿	1,600	56,560.00	0.16
138	300751	迈为股份	200	56,492.00	0.16
139	002241	歌尔股份	2,500	56,325.00	0.16
140	688271	联影医疗	556	56,283.88	0.16

141	601872	招商轮船	3,200	56,224.00	0.16
142	300390	天华新能	600	56,106.00	0.16
143	300661	圣邦股份	390	55,957.20	0.16
144	000408	藏格矿业	800	55,456.00	0.16
145	002179	中航光电	1,200	55,440.00	0.16
146	002407	多氟多	1,100	55,253.00	0.16
147	600905	三峡能源	14,700	54,537.00	0.16
148	000568	泸州老窖	700	54,264.00	0.15
149	600489	中金黄金	3,000	54,150.00	0.15
150	002080	中材科技	600	54,000.00	0.15
151	601100	恒立液压	500	53,780.00	0.15
152	600673	东阳光	1,600	53,728.00	0.15
153	601888	中国中免	1,000	53,710.00	0.15
154	600893	航发动力	1,400	53,676.00	0.15
155	300395	菲利华	400	53,492.00	0.15
156	002273	水晶光电	1,500	53,220.00	0.15
157	600010	包钢股份	23,800	53,074.00	0.15
158	603288	海天味业	1,600	53,056.00	0.15
159	601006	大秦铁路	11,500	53,015.00	0.15
160	000630	铜陵有色	8,300	52,788.00	0.15
161	601658	邮储银行	10,600	52,258.00	0.15
162	688469	芯联集成	4,843	51,384.23	0.15
163	688235	百济神州	200	50,922.00	0.15
164	601689	拓普集团	900	50,778.00	0.14
165	600118	中国卫星	600	49,230.00	0.14
166	601127	赛力斯	800	49,000.00	0.14
167	605117	德业股份	460	48,842.80	0.14
168	000807	云铝股份	2,200	48,708.00	0.14
169	002625	光启技术	1,600	48,512.00	0.14
170	600019	宝钢股份	8,900	48,327.00	0.14
171	300058	蓝色光标	3,500	48,160.00	0.14

172	601727	上海电气	6,800	47,600.00	0.14
173	002027	分众传媒	9,700	46,948.00	0.13
174	300037	新宙邦	500	46,425.00	0.13
175	002422	科伦药业	1,200	46,224.00	0.13
176	000426	兴业银锡	1,400	46,144.00	0.13
177	601168	西部矿业	1,700	46,138.00	0.13
178	688396	华润微	472	46,043.60	0.13
179	600104	上汽集团	4,700	45,872.00	0.13
180	002001	新 和 成	1,600	45,472.00	0.13
181	600795	国电电力	9,700	45,299.00	0.13
182	300450	先导智能	1,100	44,792.00	0.13
183	600988	赤峰黄金	1,700	44,744.00	0.13
184	605589	圣泉集团	700	44,499.00	0.13
185	000831	中国稀土	800	44,392.00	0.13
186	601390	中国中铁	10,600	44,202.00	0.13
187	600585	海螺水泥	2,600	44,070.00	0.13
188	600667	太极实业	1,500	43,770.00	0.12
189	601669	中国电建	9,300	43,710.00	0.12
190	600362	江西铜业	1,000	43,300.00	0.12
191	600875	东方电气	1,500	43,155.00	0.12
192	600989	宝丰能源	2,100	42,693.00	0.12
193	000960	锡业股份	1,000	42,690.00	0.12
194	000538	云南白药	900	42,633.00	0.12
195	688111	金山办公	200	42,610.00	0.12
196	300316	晶盛机电	700	42,280.00	0.12
197	300015	爱尔眼科	5,100	42,126.00	0.12
198	600885	宏发股份	1,220	42,077.80	0.12
199	600392	盛和资源	1,400	41,678.00	0.12
200	600547	山东黄金	1,800	41,562.00	0.12
201	600418	江淮汽车	1,600	41,328.00	0.12
202	002738	中矿资源	700	41,293.00	0.12

203	688099	晶晨股份	400	41,160.00	0.12
204	600760	中航沈飞	1,000	41,100.00	0.12
205	600346	恒力石化	2,300	40,733.00	0.12
206	002812	恩捷股份	600	40,146.00	0.11
207	002648	卫星化学	1,700	39,933.00	0.11
208	002195	岩山科技	6,100	39,894.00	0.11
209	002126	银轮股份	800	39,840.00	0.11
210	601868	中国能建	14,900	39,783.00	0.11
211	600096	云天化	1,300	39,520.00	0.11
212	600482	中国动力	1,200	39,360.00	0.11
213	000625	长安汽车	5,400	38,718.00	0.11
214	600157	永泰能源	23,700	38,157.00	0.11
215	688266	泽璟制药	327	38,147.82	0.11
216	301358	湖南裕能	500	37,935.00	0.11
217	000157	中联重科	5,400	37,638.00	0.11
218	600141	兴发集团	800	37,576.00	0.11
219	601179	中国西电	2,500	37,300.00	0.11
220	002129	TCL中环	3,100	37,262.00	0.11
221	600143	金发科技	2,400	37,080.00	0.11
222	300803	指南针	400	36,668.00	0.10
223	600011	华能国际	4,800	36,432.00	0.10
224	600580	卧龙电驱	1,100	36,410.00	0.10
225	002340	格林美	5,500	36,355.00	0.10
226	600497	驰宏锌锗	3,000	36,330.00	0.10
227	300418	昆仑万维	900	36,324.00	0.10
228	000066	中国长城	1,900	36,195.00	0.10
229	000933	神火股份	1,700	36,040.00	0.10
230	002558	巨人网络	1,300	35,828.00	0.10
231	600115	中国东航	9,200	35,052.00	0.10
232	600066	宇通客车	1,300	34,853.00	0.10
233	688036	传音控股	591	34,839.45	0.10

234	603659	璞泰来	1,200	34,716.00	0.10
234	300759	康龙化成	1,200	34,716.00	0.10
235	300339	润和软件	900	34,659.00	0.10
236	601233	桐昆股份	1,600	34,640.00	0.10
237	002236	大华股份	2,100	34,629.00	0.10
238	600570	恒生电子	1,600	33,904.00	0.10
239	688506	百利天恒	115	33,813.45	0.10
240	600048	保利发展	7,300	33,799.00	0.10
241	600895	张江高科	900	33,525.00	0.10
242	600426	华鲁恒升	1,400	33,488.00	0.10
243	600221	海航控股	24,800	33,480.00	0.10
244	002131	利欧股份	7,000	33,250.00	0.09
245	000301	东方盛虹	2,900	33,205.00	0.09
246	300438	鹏辉能源	400	33,140.00	0.09
247	600711	盛屯矿业	3,000	32,910.00	0.09
248	300782	卓胜微	300	32,874.00	0.09
249	600436	片仔癀	300	32,784.00	0.09
250	000768	中航西飞	1,600	32,768.00	0.09
251	600438	通威股份	2,700	32,697.00	0.09
252	600029	南方航空	6,300	32,634.00	0.09
253	300017	网宿科技	2,500	32,525.00	0.09
254	002821	凯莱英	200	32,400.00	0.09
255	600009	上海机场	1,400	32,340.00	0.09
256	600026	中远海能	1,800	32,292.00	0.09
257	002493	荣盛石化	3,000	32,250.00	0.09
258	002532	天山铝业	3,000	32,190.00	0.09
259	605499	东鹏饮料	260	32,091.80	0.09
260	688213	思特威	298	31,906.86	0.09
261	002601	龙佰集团	1,900	31,312.00	0.09
262	688047	龙芯中科	200	30,934.00	0.09
263	688578	艾力斯	283	30,903.60	0.09

264	002517	恺英网络	1,900	30,875.00	0.09
265	601117	中国化学	4,200	30,870.00	0.09
266	600886	国投电力	2,300	30,613.00	0.09
267	000975	山金国际	1,800	30,600.00	0.09
268	601360	三六零	3,500	30,415.00	0.09
269	300207	欣旺达	1,600	30,384.00	0.09
270	600372	中航机载	2,800	30,380.00	0.09
271	600352	浙江龙盛	2,500	30,275.00	0.09
272	002456	欧菲光	3,200	30,272.00	0.09
273	002074	国轩高科	1,100	30,261.00	0.09
274	002555	三七互娱	1,600	30,192.00	0.09
275	601058	赛轮轮胎	2,600	29,978.00	0.09
276	600233	圆通速递	1,900	29,925.00	0.09
277	600674	川投能源	2,100	29,757.00	0.08
278	003816	中国广核	7,600	29,716.00	0.08
279	603650	彤程新材	300	29,394.00	0.08
280	002465	海格通信	2,300	29,371.00	0.08
281	002472	双环传动	700	29,057.00	0.08
282	300454	深信服	300	28,860.00	0.08
283	300347	泰格医药	600	28,800.00	0.08
284	002155	湖南黄金	1,190	28,405.30	0.08
285	000963	华东医药	1,000	28,120.00	0.08
286	601186	中国铁建	4,700	27,965.00	0.08
287	600741	华域汽车	1,800	27,936.00	0.08
288	600219	南山铝业	7,000	27,930.00	0.08
289	600839	四川长虹	4,000	27,920.00	0.08
290	300458	全志科技	700	27,622.00	0.08
291	601877	正泰电器	1,100	27,577.00	0.08
292	600415	小商品城	2,700	27,432.00	0.08
293	300024	机器人	1,400	27,062.00	0.08
294	002595	豪迈科技	580	27,028.00	0.08

295	001979	招商蛇口	4,200	27,006.00	0.08
296	600196	复星医药	1,200	26,964.00	0.08
297	688676	金盘科技	316	26,746.24	0.08
298	601111	中国国航	4,400	26,620.00	0.08
299	002130	沃尔核材	1,400	26,544.00	0.08
300	688331	荣昌生物	200	26,052.00	0.07
301	688122	西部超导	408	25,626.48	0.07
302	603129	春风动力	100	25,580.00	0.07
303	301236	软通动力	600	25,470.00	0.07
304	002128	电投能源	1,100	25,432.00	0.07
305	000878	云南铜业	1,600	25,408.00	0.07
306	002414	高德红外	1,900	25,194.00	0.07
307	300115	长盈精密	900	25,146.00	0.07
308	601319	中国人保	3,700	25,012.00	0.07
309	300012	华测检测	1,800	24,948.00	0.07
310	002271	东方雨虹	2,100	24,927.00	0.07
311	603606	东方电缆	600	24,906.00	0.07
312	000547	航天发展	1,300	24,895.00	0.07
313	300496	中科创达	400	24,716.00	0.07
314	002920	德赛西威	300	24,450.00	0.07
315	002497	雅化集团	1,200	24,444.00	0.07
316	300568	星源材质	1,300	24,336.00	0.07
317	601615	明阳智能	2,100	24,297.00	0.07
318	300474	景嘉微	400	24,192.00	0.07
319	300073	当升科技	500	24,020.00	0.07
320	688188	柏楚电子	224	23,900.80	0.07
321	002078	太阳纸业	1,900	23,731.00	0.07
322	603979	金诚信	400	23,612.00	0.07
323	601800	中国交建	4,100	23,411.00	0.07
324	000034	神州数码	840	23,310.00	0.07
325	000002	万 科 A	7,800	23,088.00	0.07

326	600588	用友网络	2,500	22,950.00	0.07
327	002025	航天电器	300	22,866.00	0.07
328	688169	石头科技	240	22,792.80	0.07
329	601021	春秋航空	500	22,790.00	0.06
330	603087	甘李药业	400	22,704.00	0.06
331	300001	特锐德	600	22,698.00	0.06
332	000423	东阿阿胶	500	22,680.00	0.06
333	002756	永兴材料	400	22,656.00	0.06
333	000733	振华科技	400	22,656.00	0.06
334	688065	凯赛生物	465	22,250.25	0.06
335	300142	沃森生物	1,700	22,083.00	0.06
336	300919	中伟新材	500	21,875.00	0.06
337	002064	华峰化学	2,300	21,827.00	0.06
338	002444	巨星科技	700	21,770.00	0.06
339	688390	固德威	200	21,702.00	0.06
340	600699	均胜电子	1,000	21,610.00	0.06
341	300748	金力永磁	700	21,595.00	0.06
342	601677	明泰铝业	1,300	21,580.00	0.06
343	000623	吉林敖东	1,200	21,276.00	0.06
344	002432	九安医疗	300	21,204.00	0.06
345	300724	捷佳伟创	300	21,180.00	0.06
346	601633	长城汽车	1,400	21,126.00	0.06
347	600039	四川路桥	2,700	21,114.00	0.06
348	300832	新产业	500	21,000.00	0.06
349	300866	安克创新	200	20,900.00	0.06
350	600085	同仁堂	900	20,799.00	0.06
351	300083	创世纪	1,500	20,430.00	0.06
352	688223	晶科能源	4,296	20,406.00	0.06
353	002252	上海莱士	4,700	20,398.00	0.06
354	688599	天合光能	1,428	20,163.36	0.06
355	600521	华海药业	1,400	20,160.00	0.06

356	300003	乐普医疗	1,700	20,145.00	0.06
357	688472	阿特斯	1,861	20,136.02	0.06
358	300432	富临精工	1,000	20,090.00	0.06
359	300699	光威复材	700	20,055.00	0.06
360	000661	长春高新	300	19,980.00	0.06
361	000786	北新建材	1,100	19,899.00	0.06
362	000415	渤海租赁	4,800	19,536.00	0.06
363	300558	贝达药业	300	19,521.00	0.06
364	600704	物产中大	4,100	19,352.00	0.06
365	600499	科达制造	1,400	19,320.00	0.06
366	603260	合盛硅业	400	19,304.00	0.06
367	600226	亨通股份	2,000	19,180.00	0.05
368	002294	信立泰	600	19,134.00	0.05
369	600803	新奥股份	1,200	18,960.00	0.05
370	000999	华润三九	830	18,666.70	0.05
371	601607	上海医药	1,200	18,480.00	0.05
372	603806	福斯特	1,100	18,469.00	0.05
373	603596	伯特利	740	18,381.60	0.05
374	600166	福田汽车	6,300	18,333.00	0.05
375	001965	招商公路	2,000	18,320.00	0.05
376	301550	斯菱智驱	200	18,286.00	0.05
377	002007	华兰生物	1,500	18,285.00	0.05
378	600177	雅戈尔	2,400	18,072.00	0.05
379	300763	锦浪科技	200	18,070.00	0.05
380	601618	中国中冶	7,400	18,056.00	0.05
381	600332	白云山	900	18,036.00	0.05
382	600862	中航高科	1,000	18,030.00	0.05
383	002176	江特电机	1,800	18,018.00	0.05
384	603605	珀莱雅	300	17,976.00	0.05
385	002223	鱼跃医疗	700	17,962.00	0.05
386	000887	中鼎股份	1,000	17,890.00	0.05

387	002459	晶澳科技	2,200	17,820.00	0.05
388	002831	裕同科技	500	17,780.00	0.05
389	002085	万丰奥威	1,600	17,744.00	0.05
390	302132	中航成飞	300	17,496.00	0.05
391	600153	建发股份	2,200	17,446.00	0.05
392	300896	爱美客	200	17,440.00	0.05
393	000400	许继电气	800	17,360.00	0.05
394	300972	万辰集团	100	17,341.00	0.05
395	000683	博源化工	3,000	17,280.00	0.05
396	600516	方大炭素	2,800	17,276.00	0.05
397	688009	中国通号	3,618	17,221.68	0.05
398	002410	广联达	2,100	17,136.00	0.05
399	002044	美年健康	3,400	17,102.00	0.05
400	601000	唐山港	4,100	17,015.00	0.05
401	601018	宁波港	5,400	17,010.00	0.05
402	600515	海南机场	6,200	16,988.00	0.05
403	000519	中兵红箭	800	16,856.00	0.05
404	688180	君实生物	498	16,842.36	0.05
405	000830	鲁西化工	1,400	16,800.00	0.05
406	002318	久立特材	700	16,730.00	0.05
407	600170	上海建工	7,500	16,650.00	0.05
408	300251	光线传媒	1,500	16,635.00	0.05
409	688063	派能科技	312	16,620.24	0.05
410	600018	上港集团	3,500	16,520.00	0.05
411	601216	君正集团	3,700	16,502.00	0.05
412	000738	航发控制	900	16,461.00	0.05
413	688005	容百科技	537	16,432.20	0.05
414	600998	九州通	3,500	16,415.00	0.05
415	688617	惠泰医疗	90	16,340.40	0.05
416	002266	浙富控股	3,200	16,192.00	0.05
417	300409	道氏技术	800	15,944.00	0.05

418	002065	东华软件	2,200	15,708.00	0.04
419	300677	英科医疗	400	15,668.00	0.04
420	002405	四维图新	2,400	15,528.00	0.04
421	600765	中航重机	1,200	15,504.00	0.04
422	000932	华菱钢铁	4,400	15,268.00	0.04
423	603486	科沃斯	300	15,225.00	0.04
424	600486	扬农化工	300	15,210.00	0.04
425	600038	中直股份	600	15,174.00	0.04
426	000032	深桑达 A	600	14,970.00	0.04
427	300118	东方日升	1,200	14,940.00	0.04
428	605090	九丰能源	400	14,868.00	0.04
429	600529	山东药玻	800	14,760.00	0.04
430	600398	海澜之家	2,800	14,644.00	0.04
431	688114	华大智造	284	14,506.72	0.04
432	000617	中油资本	2,200	14,498.00	0.04
433	600208	衢州发展	5,100	14,433.00	0.04
434	603766	隆鑫通用	1,200	14,316.00	0.04
435	300573	兴齐眼药	348	14,184.48	0.04
436	600312	平高电气	800	14,128.00	0.04
437	300342	天银机电	300	14,100.00	0.04
438	600820	隧道股份	2,700	14,067.00	0.04
439	300122	智飞生物	1,200	14,028.00	0.04
440	600161	天坛生物	1,200	13,896.00	0.04
441	600323	瀚蓝环境	500	13,730.00	0.04
442	601238	广汽集团	2,700	13,716.00	0.04
443	000967	盈峰环境	1,300	13,689.00	0.04
444	600763	通策医疗	400	13,552.00	0.04
445	603392	万泰生物	500	13,485.00	0.04
446	601567	三星电气	900	13,446.00	0.04
447	603816	顾家家居	600	13,416.00	0.04
448	688166	博瑞医药	382	13,373.82	0.04

449	600511	国药股份	500	13,020.00	0.04
450	002389	航天彩虹	700	12,439.00	0.04
451	603899	晨光股份	600	12,378.00	0.04
452	688608	恒玄科技	74	12,372.06	0.04
453	600816	建元信托	5,000	12,200.00	0.03
454	000039	中集集团	1,500	12,165.00	0.03
455	002244	滨江集团	1,600	12,160.00	0.03
456	688303	大全能源	691	12,044.13	0.03
457	002603	以岭药业	800	12,000.00	0.03
458	600008	首创环保	4,400	11,968.00	0.03
459	600655	豫园股份	2,900	11,919.00	0.03
460	600535	天士力	900	11,907.00	0.03
461	300049	福瑞医科	300	11,664.00	0.03
462	600004	白云机场	1,600	11,616.00	0.03
463	000035	中国天楹	2,400	11,592.00	0.03
464	603885	吉祥航空	1,100	11,319.00	0.03
465	000998	隆平高科	1,500	11,310.00	0.03
466	688116	天奈科技	293	11,192.60	0.03
467	600316	洪都航空	400	11,176.00	0.03
468	603568	伟明环保	720	11,073.60	0.03
469	601880	辽港股份	8,000	11,040.00	0.03
470	300144	宋城演艺	1,900	11,039.00	0.03
471	600859	王府井	1,200	11,016.00	0.03
472	601866	中远海发	4,900	10,829.00	0.03
473	600754	锦江酒店	600	10,794.00	0.03
474	603939	益丰药房	600	10,788.00	0.03
475	300676	华大基因	300	10,518.00	0.03
476	300601	康泰生物	900	10,206.00	0.03
477	002607	中公教育	5,600	10,080.00	0.03
478	600864	哈投股份	1,900	9,861.00	0.03
479	300070	碧水源	3,000	9,570.00	0.03

480	002120	韵达股份	1,500	9,540.00	0.03
481	601155	新城控股	900	9,234.00	0.03
482	002544	普天科技	500	9,110.00	0.03
483	601799	星宇股份	100	9,062.00	0.03
484	600258	首旅酒店	800	8,736.00	0.02
485	002091	江苏国泰	1,200	8,676.00	0.02
486	300457	赢合科技	400	8,432.00	0.02
487	300100	双林股份	300	8,334.00	0.02
488	000069	华侨城 A	4,700	7,708.00	0.02
489	600325	华发股份	3,200	7,392.00	0.02
490	002292	奥飞娱乐	1,100	7,216.00	0.02
491	002572	索菲亚	900	6,570.00	0.02
492	603833	欧派家居	200	6,022.00	0.02
493	002891	中宠股份	200	5,344.00	0.02
494	000833	粤桂股份	200	4,684.00	0.01
495	600064	南京高科	500	3,565.00	0.01
496	600663	陆家嘴	500	3,140.00	0.01
497	600635	大众公用	700	2,996.00	0.01
498	301078	孩子王	300	2,028.00	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

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	300308	中际旭创	399,161.00	1.10
2	688498	源杰科技	301,770.00	0.83
3	300750	宁德时代	230,423.00	0.64

4	600519	贵州茅台	138,886.00	0.38
5	688525	佰维存储	135,880.00	0.37
6	300502	新易盛	135,283.00	0.37
7	601318	中国平安	112,869.00	0.31
8	601899	紫金矿业	112,402.00	0.31
9	603986	兆易创新	106,233.00	0.29
10	301308	江波龙	104,944.00	0.29
11	600036	招商银行	98,050.00	0.27
12	688347	华虹宏力	93,982.00	0.26
13	000333	美的集团	86,982.00	0.24
14	002602	世纪华通	78,141.00	0.22
15	000657	中钨高新	77,410.00	0.21
16	300857	协创数据	75,354.00	0.21
17	300059	东方财富	67,363.00	0.19
18	601166	兴业银行	64,238.00	0.18
19	300033	同花顺	64,197.00	0.18
20	300475	香农芯创	59,510.00	0.16

注：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。

7.4.2 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	300308	中际旭创	543,529.00	1.50
2	300750	宁德时代	466,335.00	1.29
3	600519	贵州茅台	275,342.00	0.76
4	601318	中国平安	238,539.00	0.66
5	601899	紫金矿业	234,515.00	0.65
6	300502	新易盛	222,826.00	0.61

7	600036	招商银行	193,219.00	0.53
8	603986	兆易创新	189,583.00	0.52
9	000333	美的集团	164,085.00	0.45
10	600900	长江电力	125,064.00	0.34
11	601166	兴业银行	124,823.00	0.34
12	300059	东方财富	124,653.00	0.34
13	002594	比亚迪	114,528.00	0.32
14	002475	立讯精密	110,274.00	0.30
15	002371	北方华创	107,078.00	0.30
16	600030	中信证券	99,084.00	0.27
17	601398	工商银行	92,776.00	0.26
18	601088	中国神华	91,739.00	0.25
19	000725	京东方 A	90,393.00	0.25
20	600276	恒瑞医药	89,185.00	0.25

注：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。

7.4.3 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	5,437,726.12
卖出股票收入（成交）总额	10,280,171.65

注：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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券中，招商银行在报告编制日前一年内受过立案调查或公开处罚，本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

本基金投资的其余前十名证券的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没有超出基金合同约定的备选股票库。

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	4,733.59
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	38,690.92

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	43,424.51

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

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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持 有 人 户 数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
汇安 中证A 500指 数A	257	14,427.79	0.00	0.00%	3,707,940.88	100.00%
汇安 中证A	396	55,901.42	876,438.09	3.96%	21,260,523.41	96.04%

500指数C						
合计	637	40,572.85	876,438.09	3.39%	24,968,464.29	96.61%

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	汇安中证A500指数A	21,707.37	0.5854%
	汇安中证A500指数C	0.00	0.0000%
	合计	21,707.37	0.0840%

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	汇安中证A500指数A	0
	汇安中证A500指数C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇安中证A500指数A	0~10
	汇安中证A500指数C	0
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	汇安中证A500指数A	汇安中证A500指数C
基金合同生效日(2025年01月24日)基金份额总额	12,048,516.92	210,904,373.13

本报告期期初基金份额总额	5,505,009.29	24,215,571.17
本报告期基金总申购份额	2,965,671.19	7,275,785.55
减：本报告期基金总赎回份额	4,762,739.60	9,354,395.22
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	3,707,940.88	22,136,961.50

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

基金管理人自2026年4月21日0:00起至2026年5月19日17:00止，以通讯方式召开汇安中证A500指数证券投资基金的基金份额持有人大会，审议《关于持续运作汇安中证A500指数证券投资基金的议案》。经统计，有效参加基金份额持有人大会表决的基金份额未达到法定的基金份额持有人大会召开条件。基金管理人已于2026年5月21日在指定信息披露媒介及公司网站上就会议情况进行了公告。

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，基金管理人无重大人事变动。

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

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事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金在报告期内基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自2024年9月14日至本报告期末聘任容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本报告期内未发生变动。

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，本基金管理人未受到调查或处罚。

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，本基金管理人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

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	
天风证券	2	15,717,897.77	100.00%	2,921.88	100.00%	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：

选择专用席位的标准和程序：

（1）选择标准

1、综合实力较强、市场信誉良好；

2、财务状况良好，经营状况稳健；

3、经营行为规范，具备健全的内部控制制度；

4、研究实力较强，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；能够积极进行业务交流，定期进行观点交流和路演；能够提供实地调研等多种类型的研究服务；

5、具有佣金费率优势，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，能提供全面的交易信息服务；

6、从制度上和技术上保证管理人租用交易单元的交易信息严格保密。

（2）选择程序

1、本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的券商。

2、本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议。

(3) 交易单元变更情况

本基金本报告期内无交易单元变更。

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	汇安中证A500指数证券投资基金2025年第4季度报告	规定报刊和/或公司网站	2026-01-22
2	汇安基金管理有限责任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）	规定报刊和/或公司网站	2026-03-31
3	汇安中证A500指数证券投资基金2025年年度报告	规定报刊和/或公司网站	2026-03-31
4	汇安基金管理有限责任公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件及其他身份基本信息的公告	规定报刊和/或公司网站	2026-04-03
5	汇安基金管理有限责任公司关于以通讯方式召开汇安中	规定报刊和/或公司网站	2026-04-20

	证A500指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告		
6	汇安基金管理有限责任公司关于以通讯方式召开汇安中证A500指数证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	规定报刊和/或公司网站	2026-04-21
7	汇安基金管理有限责任公司关于以通讯方式召开汇安中证A500指数证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	规定报刊和/或公司网站	2026-04-22
8	汇安中证A500指数证券投资基金2026年第1季度报告	规定报刊和/或公司网站	2026-04-22
9	汇安基金管理有限责任公司关于浙江分公司成立的公告	规定报刊和/或公司网站	2026-04-22
10	汇安基金管理有限责任公司关于汇安中证A500指数证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告	规定报刊和/或公司网站	2026-05-21
11	汇安基金管理有限责任公司关于旗下部分基金在直销渠道开展费率优惠活动的公告	规定报刊和/或公司网站	2026-06-30

§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

本基金本报告期内未存在单一基金份额持有人持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准汇安中证A500指数证券投资基金募集的文件

- (2) 《汇安中证A500指数证券投资基金基金合同》
- (3) 《汇安中证A500指数证券投资基金招募说明书》
- (4) 《汇安中证A500指数证券投资基金托管协议》
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (6) 在规定报刊及规定网站上披露的各项公告
- (7) 中国证监会规定的其他文件

12.2 存放地点

北京市东城区东直门南大街5号中青旅大厦13层

上海市虹口区东大名路501白玉兰大厦36层

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所及网站免费查阅备查文件，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人汇安基金管理有限责任公司，客户服务中心电话010-56711690。

公司网站：<http://www.huianfund.cn>

汇安基金管理有限责任公司

二〇二六年八月三十一日