

中银证券中证 500 交易型开放式指数证券  
投资基金  
2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：中银国际证券股份有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>11</b>
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内容的真实、准确和完整发表意见	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>43</b>
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
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	59
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	59

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 .....	59
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 .....	59
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	60
7.12 投资组合报告附注 .....	60
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>62</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	62
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	62
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	62
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 .....	62
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>63</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>63</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	63
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 .....	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	63
10.4 基金投资策略的改变 .....	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	64
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	64
10.8 其他重大事件 .....	65
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>66</b>
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 .....	66
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	66
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>66</b>
12.1 备查文件目录 .....	66
12.2 存放地点 .....	67
12.3 查阅方式 .....	67

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	中银证券中证 500ETF
场内简称	BOCI500 扩位简称：中银证券 500ETF
基金主代码	515190
基金运作方式	契约型开放（ETF）
基金合同生效日	2020 年 4 月 30 日
基金管理人	中银国际证券股份有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	53,466,080.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020 年 5 月 27 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。 当预期指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将通过投资非成份股、成份股个股衍生品等方式进行替代，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为交易型开放式指数基金，采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	中银国际证券股份有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	亓磊
	联系电话	021-20328000
	电子邮箱	gmkf@bocichina.com
客户服务电话	021-61195566, 400-620-8888	95555

传真	021-50372474	0755-83195201
注册地址	上海市浦东新区银城中路 200 号 中银大厦 39F	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	上海市浦东新区银城中路 200 号 中银大厦 39F	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	200120	518040
法定代表人	宁敏	缪建民

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中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(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	200,128.72
本期利润	-6,769,726.58
加权平均基金份额本期利润	-0.1368
本期加权平均净值利润率	-10.87%
本期基金份额净值增长率	-11.42%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	15,509,750.19
期末可供分配基金份额利润	0.2901
期末基金资产净值	68,975,830.19
期末基金份额净值	1.2901
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	29.01%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

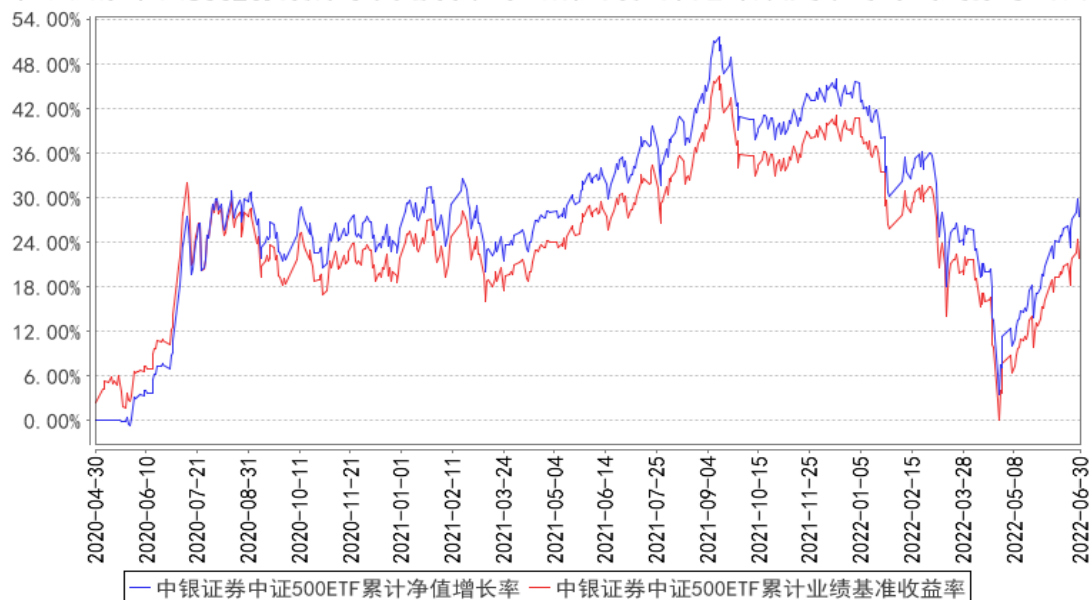
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	7.84%	1.09%	7.10%	1.10%	0.74%	-0.01%
过去三个月	3.14%	1.74%	2.04%	1.75%	1.10%	-0.01%
过去六个月	-11.42%	1.62%	-12.30%	1.63%	0.88%	-0.01%
过去一年	-4.47%	1.32%	-5.20%	1.33%	0.73%	-0.01%
自基金合同生效起至今	29.01%	1.23%	23.48%	1.27%	5.53%	-0.04%

注：业绩比较基准为中证 500 指数收益率。

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

中银证券中证500ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同生效日为 2020 年 4 月 30 日。

### 3.3 其他指标

注：无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中银国际证券股份有限公司(以下简称“中银国际证券”)经中国证监会批准于 2002 年 2 月 28 日在上海成立,注册资本 27.78 亿元人民币。前十名股东包括中银国际控股有限公司、中国石油集团资本有限责任公司、江西铜业股份有限公司、江苏洋河酒厂股份有限公司、云南省投资控股集团有限公司、中国通用技术(集团)控股有限责任公司、上海金融发展投资基金(有限合伙)、香港中央结算有限公司、上海祥众投资合伙企业(有限合伙)、华润深国投信托有限公司—华润信托•恒嘉 1 号集合资金信托计划。中银国际证券的经营经营范围包括:证券经纪;证券投资咨询;与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问;证券承销与保荐;证券自营;证券资产管理;证券投资基金代销;融资融券;代销金融产品;公开募集证券投资基金管理业务;为期货公司提供中间介绍业务。截至 2022 年 6 月 30 日,本管理人共管理 40 只证券投资基金,包括:中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金(原中银证券保本 1 号混合型证券投资基金)、中银证券健康产业灵活配置混合型证券投资基金、中银证券现金管家货币市场基金、中银证券安进债券型证券投资基金、中银证券瑞益灵活配置混合型证券投资基金(原中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金)、中银证券安弘债券型证券投资基金、中银证券汇宇定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券聚瑞混合型证券投资基金、中银证券祥瑞混合型证券投资基金、中银证券汇嘉定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券安誉债券型证券投资基金、中银证券汇享定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券新能源灵活配置混合型证券投资基金、中银证券安源债券型证券投资基金、中银证券中高等级债券型证券投资基金、中银证券安泽债券型证券投资基金、中银证券科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、中银证券安沛债券型证券投资基金、中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中银证券汇远一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券汇兴一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券安泰债券型证券投资基金、中银证券优选行业龙头混合型证券投资基金、中银证券安汇三年定期开放债券型证券投资基金、中银证券创业板交易型开放式指数证券投资基金、中银证券鑫瑞 6 个月持有期混合型证券投资基金、中银证券精选行业股票型证券投资基金、中银证券汇福一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券均衡成长混合型证券投资基金、中银证券创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、中银证券盈瑞混合型证券投资基金、中银证券优势制造股票型证券投资基金、中银证券安灏债券型证券投资基金、中银证券安业债券型证券投资基金、中银证券内需增长混合型证券投资基金、中银证券恒瑞



9 个月持有期混合型证券投资基金、中银证券远见价值混合型证券投资基金、中银证券成长领航混合型证券投资基金、中银证券安瑞 6 个月持有期债券型证券投资基金。

#### 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		
张艺敏	本基金的基金经理	2020 年 9 月 15 日	-	4 年	张艺敏，硕士研究生，中国国籍，已取得证券、基金从业资格。2017 年 7 月至 2020 年 5 月任职于汇安基金管理有限公司，历任产品及创新业务部产品经理、ETF 投资部基金经理助理，2020 年 5 月加入中银国际证券股份有限公司，现任中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中银证券创业板交易型开放式指数证券投资基金、中银证券创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。
计伟	本基金的基金经理	2021 年 6 月 8 日	-	14 年	计伟，硕士研究生，中国国籍，已取得证券、基金从业资格。2012 年 1 月至 2016 年 8 月任职于华安基金管理有限公司，担任基金经理；2016 年 8 月至 2019 年 7 月任职于汇安基金管理有限公司，担任指数与量化投资副总经理、ETF 投资部总经理、基金经理；2019 年 10 月加入中银国际证券股份有限公司，现任基金管理部 ETF 投资团队负责人及中银证券创业板交易型开放式指数证券投资基金、中银证券祥瑞混合型证券投资基金、中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

注：1、上述任职日期为根据公司确定的聘任日期，离任日期为根据公司确定的解聘日期；首任基金经理的任职日期为基金合同生效日。

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

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、基金合同以及其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基

金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了保证公司管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益，本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，建立了基金管理业务、资产管理业务公平交易管理办法、研究与交易部交易室异常交易监控与报告管理办法等公平交易相关制度体系。公司基金管理业务、资产管理业务公平交易管理办法所规范的范围涵盖境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，同时涵盖包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

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

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金主要采取完全复制法以紧密跟踪标的指数表现，力争基金跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金本报告期内日均跟踪偏离度为 0.02%，年化跟踪误差为 0.39%。本基金的跟踪误差主要来源于基金份额的申购赎回、标的指数成分股调整等。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.2901 元；本报告期基金份额净值增长率为-11.42%，业绩比较基准收益率为-12.30%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金作为一只投资于中证 500 指数的被动投资管理产品，将继续秉承指数化投资策略，严

格遵守基金合同，积极应对基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，降低本基金的跟踪误差，为投资者提供一个标准化的中证 500 指数投资工具。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理人作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未实施利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

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

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	817,627.46	761,607.36
结算备付金		18,906.56	10,813.72
存出保证金		4,376.71	6,263.60
交易性金融资产	6.4.7.2	68,337,707.67	65,702,928.91
其中：股票投资		68,333,706.92	65,699,928.91
基金投资		-	-
债券投资		4,000.75	3,000.00
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		-	76,393.11
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	75,616.24	91.80
资产总计		69,254,234.64	66,558,098.50

负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>负 债:</b>			
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		480.10	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		8,266.18	8,363.48
应付托管费		2,755.41	2,787.81
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	266,902.76	332,106.35
负债合计		278,404.45	343,257.64
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.10	53,466,080.00	45,466,080.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	15,509,750.19	20,748,760.86
净资产合计		68,975,830.19	66,214,840.86
负债和净资产总计		69,254,234.64	66,558,098.50

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.2901 元，基金份额总额 53,466,080.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-6,459,149.54	6,911,583.98
1. 利息收入		1,589.84	3,023.18
其中：存款利息收入	6.4.7.13	1,589.84	3,018.56
债券利息收入		-	4.62
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-

证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		428,768.67	10,094,955.94
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-325,815.41	9,385,793.35
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	4,735.09	2,042.18
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	749,848.99	707,120.41
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	-6,969,855.30	-3,262,598.35
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	80,347.25	76,203.21
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>310,577.04</b>	<b>451,677.73</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	46,219.61	62,703.94
2. 托管费	6.4.10.2.2	15,406.56	20,901.32
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		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	248,950.87	368,072.47
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-6,769,726.58</b>	<b>6,459,906.25</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-6,769,726.58</b>	<b>6,459,906.25</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-6,769,726.58</b>	<b>6,459,906.25</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 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(基金净值)	45,466,080.00	-	20,748,760.86	66,214,840.86
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本年期初净资产(基金净值)	45,466,080.00	-	20,748,760.86	66,214,840.86
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	8,000,000.00	-	-5,239,010.67	2,760,989.33
(一)、综合收益总额	-	-	-6,769,726.58	-6,769,726.58
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	8,000,000.00	-	1,530,715.91	9,530,715.91
其中：1. 基金申购款	10,000,000.00	-	1,988,870.16	11,988,870.16
2. 基金赎回款	-2,000,000.00	-	-458,154.25	-2,458,154.25

(三)、 本期向 基金份额 持有人分 配利润产 生的基金 净值变动 (净值减少 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(基金 净值)	53,466,080.00	-	15,509,750.19	68,975,830.19
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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(基金 净值)	79,466,080.00	-	20,537,902.19	100,003,982.19
加:会计 政策变更	-	-	-	-
前期差 错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期 期初净资 产(基金 净值)	79,466,080.00	-	20,537,902.19	100,003,982.19
三、本期 增减变动 额(减少 以“-” 号填列)	-24,000,000.00	-	-1,100,192.48	-25,100,192.48



(一)、 综合收益总额	-	-	6,459,906.25	6,459,906.25
(二)、 本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-24,000,000.00	-	-7,560,098.73	-31,560,098.73
其中:1. 基金申购款	4,000,000.00	-	1,277,141.20	5,277,141.20
2. 基金赎回款	-28,000,000.00	-	-8,837,239.93	-36,837,239.93
(三)、 本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、 其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	55,466,080.00	-	19,437,709.71	74,903,789.71

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：

宁敏

基金管理人负责人

沈锋

主管会计工作负责人

戴景义

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]2052 号《关于准予中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准,由中银国际证券股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息(含募集股票市值)共募集人民币 251,438,000.00 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第 0351 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2020 年 4 月 30 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 251,466,080.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 28,080.00 份基金份额。本基金的基金管理人为中银国际证券股份有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

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

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

本基金的基金管理人中银国际证券股份有限公司以本基金为目标 ETF,募集成立了中证 500

交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“中证 500 ETF 联接基金”)。中证 500 ETF 联接基金为交易型开放式基金,投资目标与本基金类似,将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人中银国际证券股份有限公司于 2022 年 8 月 29 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》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他中国证监会、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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”),财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外,中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》,本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表,对本基金财务报表的影响列示如下:

##### 1、会计政策变更的性质、内容和原因

###### (a) 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

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

#### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

#### 债务工具

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

#### 以摊余成本计量：

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

#### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

#### 权益工具

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

#### (2) 金融负债

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

#### 原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息

继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### (b) 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

##### 新金融工具准则

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

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

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

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风

险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### (c) 收入/(损失)的确认和计量

##### 新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

##### 原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 2、当期报表中受影响的项目名称和调整金额

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

#### (a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息和应收证券清算款，金额分别为 761,607.36 元、10,813.72 元、6,263.60 元、91.80 元和 76,393.11 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息和应收清算款，金额分别为 761,690.22 元、10,819.11 元、6,266.68 元、0.00 元和 76,393.11 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 65,702,928.91 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 65,702,929.38 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 8,363.48 元、2,787.81 元、17,106.35 元和 35,000.00 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 8,363.48 元、2,787.81 元、17,106.35 元和 35,000.00 元。

#### (b) 修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

### 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[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起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。

(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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	817,627.46
等于：本金	817,519.78
加：应计利息	107.68
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	817,627.46

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	68,383,592.83	-	68,333,706.92	-49,885.91
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	4,000.00	0.75	4,000.75
	银行间市场	-	-	-
	合计	4,000.00	0.75	4,000.75
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	68,387,592.83	0.75	68,337,707.67	-49,885.91

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金本报告期内对以摊余成本计量的金融资产按预期信用损失一般模型计算的减值准备很小，故未对账面价值进行调整。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

##### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

##### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

##### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具。

#### 6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	75,616.24
合计	75,616.24

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 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	17,847.42
其中：交易所市场	17,847.42
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	214,055.34
应付指数使用费	35,000.00
合计	266,902.76

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	45,466,080.00	45,466,080.00
本期申购	10,000,000.00	10,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-2,000,000.00	-2,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	53,466,080.00	53,466,080.00

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期无其他综合收益。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	25,842,180.84	-5,093,419.98	20,748,760.86
本期利润	200,128.72	-6,969,855.30	-6,769,726.58
本期基金份额交易产生的变动数	4,546,040.70	-3,015,324.79	1,530,715.91
其中：基金申购款	5,688,845.37	-3,699,975.21	1,988,870.16
基金赎回款	-1,142,804.67	684,650.42	-458,154.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	30,588,350.26	-15,078,600.07	15,509,750.19

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,352.68
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	210.39
其他	26.77
合计	1,589.84

#### 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
	2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-333,426.86
股票投资收益——赎回差价收入	7,611.45
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	-325,815.41

##### 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
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	12,772,610.07
减：卖出股票成本总额	13,068,582.97
减：交易费用	37,453.96
买卖股票差价收入	-333,426.86

##### 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
	2022年1月1日至2022年6月30日
赎回基金份额对价总额	2,458,154.25
减：现金支付赎回款总额	1,155,124.25
减：赎回股票成本总额	1,295,418.55
减：交易费用	-
赎回差价收入	7,611.45

##### 6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益——申购差价收入。

##### 6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益-证券出借差价收入。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	7.21
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	4,727.88
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	4,735.09

##### 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 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	32,735.96
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	28,000.00
减：应计利息总额	6.93
减：交易费用	1.15
买卖债券差价收入	4,727.88

##### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益-赎回差价收入。

##### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益-申购差价收入。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-赎回差价收入。

##### 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-申购差价收入。

**6.4.7.17 贵金属投资收益****6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

**6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-赎回差价收入。

**6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-申购差价收入。

**6.4.7.18 衍生工具收益****6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

**6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本基金本报告期内无衍生工具收益-其他投资收益。

**6.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	749,848.99
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	749,848.99

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	-6,969,855.30
股票投资	-6,969,855.30
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	-6,969,855.30

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	80,347.25
合计	80,347.25

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

#### 6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	14,795.19
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行费用	509.77
指数使用费	70,000.00
其他费用	123,974.33
合计	248,950.87

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的年费率 0.03% 每日计提，按季支付。自基金成立之日的下一季度（自然季度）起，指数使用许可费收取下限为每季度（自然季度）3.5 万元，即不足 3.5 万元时按照 3.5 万元收取。

#### 6.4.7.24 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。



本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中银国际证券股份有限公司（“中银证券”）	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金管理人股东的控股股东
中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“中证 500ETF 联接基金”）	基金管理人管理的其他基金

注：下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
中银证券	30,420,044.57	100.00	57,541,111.12	100.00

###### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
中银证券	32,735.96	100.00	36,046.80	100.00

### 6.4.10.1.3 债券回购交易

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

### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
中银证券	22,250.19	100.00	17,847.42	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
中银证券	42,080.40	100.00	25,120.73	100.00

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示；

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

### 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 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	46,219.61	62,703.94
其中：支付销售机构的客户维护费	6.98	2.88

注：支付基金管理人中银证券的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	15,406.56	20,901.32

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无支付给各关联方的销售服务费。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：本基金本报告期内与上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

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

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人于本基金本报告期内及上年度可比期间未运用自有资金投资本基金。

##### 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 2022年6月30日		上年度末 2021年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例（%）
中证 500 ETF 联接基金	43,014,980.00	80.4500	34,860,500.00	76.6700

#### 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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	817,627.46	1,352.68	989,192.49	2,139.46

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

为了更好地实现基金合同所规定的投资目标，紧密跟踪标的指数，提高基金运作效率，本基金根据基金合同约定的投资策略，按照标的指数的成分股组成及其权重构建基金股票投资组合，在报告期内投资于基金管理人中银证券发行的股票中银证券。于 2022 年 6 月 30 日，本基金持有中银证券的 A 股的估值总额为人民币 230,090.00 元。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末(2022 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
127064	杭氧转债	2022 年 5 月 19 日	1-6 个月(含)	新债流通受限	100.00	100.00	40	4,000.00	4,000.00	-

##### 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
002670	国盛金控	2022 年 6 月 1 日	重大事项停牌	9.60	2022 年 7 月 14 日	9.99	13,400	123,743.45	128,640.00	-

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务的证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

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

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金，紧密跟踪中证 500 指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪中证 500 指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人在公司风险管理体系的基础上构建明晰基金业务的风险管理组织架构和职能，由董事会及其风险控制委员会、执行委员会、风险管理委员会、风险管理部、基金管理部、中后线部门等相关业务部门构成多层级风险管理框架体系。董事会决定公司风险偏好，并在风险控制委员会的协助下监察公司基金业务的总体风险及管理状况。执行委员会领导公司基金业务的风险管理。风险管理委员会协助执行委员会在董事会授权范围内确定、调整基金业务的业务权限、讨论重大决策以及检查风险管理状况。风险管理部、信评与投资监督部负责监控和报告公司基金业务的风险敞口和限额使用情况。业务主管对各自业务的风险管理负有首要责任。财务、业务营运、稽核、法律及合规等中后线部门在各自职能范围内支持或监督公司风险管理。

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行招商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性

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。

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

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：截至 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有期限在一年以内(含)的债券。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：截至 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有期限在一年以内(含)的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：截至 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有期限在一年以内(含)的同业存单。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	4,000.00	3,000.00
未评级	-	-
合计	4,000.00	3,000.00

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：截至 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有期限大于一年的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：截至 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有期限大于一年的同业存单。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于 2022 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息。本基金赎回基金采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：不适用。

### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持证券在证券交易所上市，此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2022 年 6 月 30 日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2022 年 6 月 30 日，本基金确认的净赎回申请未超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算

备付金和存出保证金等。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	817,519.78	-	-	107.68	817,627.46
结算备付金	18,898.06	-	-	8.50	18,906.56
存出保证金	4,374.71	-	-	2.00	4,376.71
交易性金融资产	4,000.00	-	-	68,333,707.67	68,337,707.67
其他资产	-	-	-	75,616.24	75,616.24
资产总计	844,792.55	-	-	68,409,442.09	69,254,234.64
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	8,266.18	8,266.18
应付托管费	-	-	-	2,755.41	2,755.41
应付清算款	-	-	-	480.10	480.10
其他负债	-	-	-	266,902.76	266,902.76
负债总计	-	-	-	278,404.45	278,404.45
利率敏感度缺口	844,792.55	-	-	68,131,037.64	68,975,830.19
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	761,607.36	-	-	-	761,607.36
结算备付金	10,813.72	-	-	-	10,813.72
存出保证金	6,263.60	-	-	-	6,263.60
交易性金融资产	-	-	3,000.00	65,699,928.91	65,702,928.91
应收利息	-	-	-	91.80	91.80
应收证券清算款	-	-	-	76,393.11	76,393.11
资产总计	778,684.68	-	3,000.00	65,776,413.82	66,558,098.50
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	8,363.48	8,363.48
应付托管费	-	-	-	2,787.81	2,787.81
应付交易费用	-	-	-	17,106.35	17,106.35
其他负债	-	-	-	315,000.00	315,000.00
负债总计	-	-	-	343,257.64	343,257.64
利率敏感度缺口	778,684.68	-	3,000.00	65,433,156.18	66,214,840.86

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2022 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.0058%（2021 年 12 月 31 日：0.0045%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2020



年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：不适用。

##### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：不适用。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将通过投资非成份股、成份股个股衍生品等方式进行替代，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。

本基金投资于标的指数成分股及其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%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 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	68,333,706.92	99.07	65,699,928.91	99.22
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	4,000.00	0.01	3,000.00	0.00
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	68,337,706.92	99.07	65,702,928.91	99.22

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
	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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	3,423,223.18	3,109,780.00
	业绩比较基准下降5%	-3,423,223.18	-3,109,780.00

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

不适用。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	68,205,066.92	65,567,920.42
第二层次	132,640.75	135,008.49
第三层次	-	-
合计	68,337,707.67	65,702,928.91

### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券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 2022 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(2021 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	68,333,706.92	98.67
	其中：股票	68,333,706.92	98.67

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,000.75	0.01
	其中：债券	4,000.75	0.01
	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	836,534.02	1.21
8	其他各项资产	79,992.95	0.12
9	合计	69,254,234.64	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	625,388.40	0.91
B	采矿业	3,026,738.10	4.39
C	制造业	40,591,840.40	58.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,109,313.00	3.06
E	建筑业	882,134.00	1.28
F	批发和零售业	2,632,581.24	3.82
G	交通运输、仓储和邮政业	1,819,511.44	2.64
H	住宿和餐饮业	143,840.00	0.21
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,033,779.29	7.30
J	金融业	6,061,267.98	8.79
K	房地产业	1,614,537.00	2.34
L	租赁和商务服务业	825,393.00	1.20
M	科学研究和技术服务业	858,664.00	1.24
N	水利、环境和公共设施管理业	498,303.62	0.72
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	158,610.00	0.23
R	文化、体育和娱乐业	914,562.00	1.33
S	综合	500,427.00	0.73

	合计	68,296,890.47	99.02
--	----	---------------	-------

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	36,816.45	0.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	36,816.45	0.05

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 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	600522	中天科技	28,300	653,730.00	0.95
2	601615	明阳智能	17,400	588,120.00	0.85
3	600256	广汇能源	47,600	501,704.00	0.73
4	300769	德方纳米	1,100	449,548.00	0.65
5	600096	云天化	13,300	418,684.00	0.61

6	300012	华测检测	17,400	403,854.00	0.59
7	002497	雅化集团	11,900	388,535.00	0.56
8	002407	多氟多	7,900	386,389.00	0.56
9	002240	盛新锂能	6,300	380,268.00	0.55
10	300390	天华超净	4,300	375,820.00	0.54
11	002180	纳思达	7,300	369,526.00	0.54
12	600157	永泰能源	230,300	366,177.00	0.53
13	600885	宏发股份	8,680	363,258.00	0.53
14	000009	中国宝安	26,700	360,183.00	0.52
15	600141	兴发集团	8,100	356,319.00	0.52
16	300073	当升科技	3,700	334,258.00	0.48
17	600392	盛和资源	14,500	327,700.00	0.48
18	002384	东山精密	14,200	325,606.00	0.47
19	002756	永兴材料	2,100	319,641.00	0.46
20	603613	国联股份	3,570	316,302.00	0.46
21	600418	江淮汽车	18,100	310,596.00	0.45
22	300285	国瓷材料	8,300	298,136.00	0.43
23	600399	抚顺特钢	16,400	293,560.00	0.43
24	600765	中航重机	9,120	293,481.60	0.43
25	600233	圆通速递	14,200	289,538.00	0.42
26	601555	东吴证券	41,550	287,941.50	0.42
27	600563	法拉电子	1,400	287,224.00	0.42
28	601058	赛轮轮胎	25,400	286,258.00	0.42
29	600487	亨通光电	19,600	284,984.00	0.41
30	000983	山西焦煤	21,250	284,537.50	0.41
31	300037	新宙邦	5,400	283,824.00	0.41
32	600499	科达制造	13,700	282,768.00	0.41
33	600732	爱旭股份	8,400	277,368.00	0.40
34	603077	和邦生物	64,100	273,066.00	0.40
35	603456	九洲药业	5,200	268,840.00	0.39
36	002385	大北农	34,300	267,883.00	0.39
37	688122	西部超导	2,900	267,380.00	0.39
38	601108	财通证券	33,700	265,219.00	0.38
39	300363	博腾股份	3,400	265,166.00	0.38
40	688180	君实生物	3,500	263,690.00	0.38
41	688099	晶晨股份	2,600	262,600.00	0.38
42	002268	卫士通	6,100	261,751.00	0.38
43	000519	中兵红箭	8,700	253,605.00	0.37
44	600298	安琪酵母	5,200	253,500.00	0.37
45	600486	扬农化工	1,900	253,232.00	0.37
46	603345	安井食品	1,500	251,805.00	0.37
47	300144	宋城演艺	16,300	250,205.00	0.36

48	000630	铜陵有色	76,400	249,064.00	0.36
49	600862	中航高科	8,700	244,470.00	0.35
50	002353	杰瑞股份	6,000	241,800.00	0.35
51	603605	珀莱雅	1,460	241,162.80	0.35
52	000988	华工科技	10,400	240,968.00	0.35
53	000783	长江证券	40,100	237,793.00	0.34
54	601077	渝农商行	64,200	237,540.00	0.34
55	601168	西部矿业	19,800	234,234.00	0.34
56	002625	光启技术	13,400	231,418.00	0.34
57	601696	中银证券	17,300	230,090.00	0.33
58	300146	汤臣倍健	10,600	229,490.00	0.33
59	601162	天风证券	71,900	228,642.00	0.33
60	688777	中控技术	3,100	225,556.00	0.33
61	002028	思源电气	6,300	224,658.00	0.33
62	002056	横店东磁	8,400	223,608.00	0.32
63	300724	捷佳伟创	2,500	223,375.00	0.32
64	002797	第一创业	34,800	223,068.00	0.32
65	002507	涪陵榨菜	6,400	220,928.00	0.32
66	600988	赤峰黄金	13,800	220,110.00	0.32
67	603517	绝味食品	3,800	219,716.00	0.32
68	000932	华菱钢铁	43,000	218,870.00	0.32
69	002185	华天科技	23,300	218,554.00	0.32
70	603026	石大胜华	1,500	218,025.00	0.32
71	601128	常熟银行	28,400	216,976.00	0.31
72	603589	口子窖	3,700	216,857.00	0.31
73	601636	旗滨集团	16,700	212,925.00	0.31
74	002603	以岭药业	8,700	211,410.00	0.31
75	600521	华海药业	9,300	211,110.00	0.31
76	002326	永太科技	6,400	210,752.00	0.31
77	600039	四川路桥	19,900	209,547.00	0.30
78	600109	国金证券	23,200	208,800.00	0.30
79	601607	上海医药	11,500	207,920.00	0.30
80	000830	鲁西化工	11,900	205,751.00	0.30
81	002078	太阳纸业	16,700	205,577.00	0.30
82	002624	完美世界	14,100	202,617.00	0.29
83	600153	建发股份	15,400	201,278.00	0.29
84	600546	山煤国际	10,300	200,438.00	0.29
85	605117	德业股份	700	195,923.00	0.28
86	603939	益丰药房	3,700	195,471.00	0.28
87	601872	招商轮船	33,600	193,536.00	0.28
88	603127	昭衍新药	1,700	193,460.00	0.28
89	600348	华阳股份	12,500	193,250.00	0.28

90	002422	科伦药业	10,300	192,610.00	0.28
91	600705	中航产融	55,500	192,030.00	0.28
92	600497	驰宏锌锗	36,900	191,511.00	0.28
93	000738	航发控制	6,800	191,080.00	0.28
94	601990	南京证券	22,900	190,986.00	0.28
95	600177	雅戈尔	28,800	190,944.00	0.28
96	000831	五矿稀土	6,100	190,625.00	0.28
97	600549	厦门钨业	8,800	190,256.00	0.28
98	600875	东方电气	11,500	189,175.00	0.27
99	000970	中科三环	10,060	188,926.80	0.27
100	300088	长信科技	25,400	188,468.00	0.27
101	300699	光威复材	3,200	188,384.00	0.27
102	603267	鸿远电子	1,400	188,062.00	0.27
103	300676	华大基因	2,600	186,420.00	0.27
104	000999	华润三九	4,100	184,500.00	0.27
105	600160	巨化股份	14,000	184,100.00	0.27
106	002138	顺络电子	6,700	182,575.00	0.26
107	002557	洽洽食品	3,200	182,176.00	0.26
108	600859	王府井	7,000	181,860.00	0.26
109	002673	西部证券	27,800	181,812.00	0.26
110	000998	隆平高科	10,900	181,594.00	0.26
111	002572	索菲亚	6,600	181,500.00	0.26
112	600516	方大炭素	23,700	180,120.00	0.26
113	600143	金发科技	18,700	178,024.00	0.26
114	000807	云铝股份	18,000	177,840.00	0.26
115	002508	老板电器	4,900	176,547.00	0.26
116	601997	贵阳银行	30,300	176,043.00	0.26
117	600482	中国动力	11,200	175,952.00	0.26
118	000039	中集集团	12,700	175,895.00	0.26
119	688390	固德威	560	175,285.60	0.25
120	002030	达安基因	10,160	174,650.40	0.25
121	000960	锡业股份	10,400	174,408.00	0.25
122	002273	水晶光电	14,400	174,384.00	0.25
123	002465	海格通信	19,100	173,619.00	0.25
124	601699	潞安环能	11,800	172,516.00	0.25
125	300357	我武生物	3,300	171,699.00	0.25
126	000629	攀钢钒钛	44,600	169,480.00	0.25
127	000728	国元证券	27,100	168,562.00	0.24
128	300136	信维通信	10,000	168,500.00	0.24
129	300058	蓝色光标	25,800	168,474.00	0.24
130	000975	银泰黄金	17,240	167,917.60	0.24
131	600170	上海建工	55,400	167,862.00	0.24



132	600536	中国软件	4,130	167,636.70	0.24
133	002409	雅克科技	3,000	166,530.00	0.24
134	002092	中泰化学	21,400	166,064.00	0.24
135	600704	物产中大	32,300	165,699.00	0.24
136	601577	长沙银行	20,800	164,944.00	0.24
137	689009	九号公司	3,700	164,650.00	0.24
138	600079	人福医药	10,200	163,200.00	0.24
139	002294	信立泰	5,800	162,980.00	0.24
140	603198	迎驾贡酒	2,500	162,850.00	0.24
141	600739	辽宁成大	11,100	161,838.00	0.23
142	002223	鱼跃医疗	6,200	159,092.00	0.23
143	000547	航天发展	13,300	158,802.00	0.23
144	600415	小商品城	28,500	158,745.00	0.23
145	002372	伟星新材	6,600	158,664.00	0.23
146	300244	迪安诊断	5,100	158,610.00	0.23
147	300418	昆仑万维	9,900	158,400.00	0.23
148	002739	万达电影	11,600	158,340.00	0.23
149	300558	贝达药业	2,600	158,080.00	0.23
150	000636	风华高科	8,400	157,836.00	0.23
151	002506	协鑫集成	42,400	157,728.00	0.23
152	300474	景嘉微	2,300	157,297.00	0.23
153	300253	卫宁健康	17,800	156,284.00	0.23
154	600699	均胜电子	9,900	155,529.00	0.23
155	300308	中际旭创	5,000	155,250.00	0.23
156	603444	吉比特	400	155,200.00	0.23
157	600372	中航电子	8,000	155,120.00	0.22
158	300296	利亚德	21,100	154,030.00	0.22
159	600637	东方明珠	21,200	151,580.00	0.22
160	600867	通化东宝	14,600	150,964.00	0.22
161	002683	广东宏大	5,400	150,282.00	0.22
162	600985	淮北矿业	10,300	149,968.00	0.22
163	601016	节能风电	31,200	149,760.00	0.22
164	600315	上海家化	3,500	149,625.00	0.22
165	000887	中鼎股份	8,200	149,568.00	0.22
166	601198	东兴证券	16,800	149,520.00	0.22
167	600236	桂冠电力	24,500	149,205.00	0.22
168	300832	新产业	3,300	148,863.00	0.22
169	600026	中远海能	14,400	148,752.00	0.22
170	002156	通富微电	9,600	147,840.00	0.21
171	002299	圣农发展	7,700	147,686.00	0.21
172	600171	上海贝岭	5,900	147,677.00	0.21
173	002065	东华软件	23,300	147,256.00	0.21

174	600380	健康元	11,900	146,965.00	0.21
175	600879	航天电子	22,500	146,025.00	0.21
176	600642	申能股份	25,500	144,840.00	0.21
177	300026	红日药业	18,700	143,990.00	0.21
178	600258	首旅酒店	5,800	143,840.00	0.21
179	002408	齐翔腾达	17,700	143,547.00	0.21
180	002936	郑州银行	53,348	143,506.12	0.21
181	000750	国海证券	39,500	143,385.00	0.21
182	000623	吉林敖东	9,600	141,696.00	0.21
183	000513	丽珠集团	3,900	141,219.00	0.20
184	000729	燕京啤酒	14,600	141,036.00	0.20
185	002203	海亮股份	12,200	140,910.00	0.20
186	600673	东阳光	15,600	140,244.00	0.20
187	000400	许继电气	7,300	140,160.00	0.20
188	600038	中直股份	3,100	140,120.00	0.20
189	000878	云南铜业	12,300	140,097.00	0.20
190	600820	隧道股份	22,800	139,536.00	0.20
191	688185	康希诺	700	139,356.00	0.20
192	600801	华新水泥	7,100	138,521.00	0.20
193	601717	郑煤机	9,600	138,336.00	0.20
194	002439	启明星辰	6,900	137,517.00	0.20
195	600580	卧龙电驱	9,500	136,990.00	0.20
196	600529	山东药玻	4,900	136,955.00	0.20
197	603568	伟明环保	4,100	136,817.00	0.20
198	600369	西南证券	34,400	136,568.00	0.20
199	300017	网宿科技	25,400	136,144.00	0.20
200	600316	洪都航空	4,500	136,080.00	0.20
201	688256	寒武纪	2,100	135,870.00	0.20
202	002131	利欧股份	70,000	135,800.00	0.20
203	300383	光环新网	13,000	135,460.00	0.20
204	600166	福田汽车	47,700	134,991.00	0.20
205	002183	怡亚通	18,700	134,827.00	0.20
206	600848	上海临港	9,900	134,244.00	0.19
207	002958	青农商行	40,300	133,796.00	0.19
208	002444	巨星科技	7,100	133,764.00	0.19
209	002195	二三四五	59,300	133,425.00	0.19
210	600325	华发股份	17,600	133,232.00	0.19
211	600027	华电国际	33,800	132,834.00	0.19
212	600909	华安证券	29,190	132,814.50	0.19
213	601005	重庆钢铁	69,500	132,745.00	0.19
214	600008	首创环保	45,610	132,269.00	0.19
215	300001	特锐德	7,600	131,556.00	0.19

216	300024	机器人	12,900	130,032.00	0.19
217	002670	国盛金控	13,400	128,640.00	0.19
218	000825	太钢不锈	23,600	128,620.00	0.19
219	002500	山西证券	22,330	128,174.20	0.19
220	002430	杭氧股份	4,100	128,166.00	0.19
221	002373	千方科技	11,500	127,880.00	0.19
222	002926	华西证券	16,300	127,792.00	0.19
223	300618	寒锐钴业	2,200	127,424.00	0.18
224	603218	日月股份	5,000	127,000.00	0.18
225	000050	深天马 A	12,700	126,619.00	0.18
226	000027	深圳能源	19,700	126,277.00	0.18
227	002250	联化科技	7,700	126,049.00	0.18
228	000739	普洛药业	6,100	125,904.00	0.18
229	002212	天融信	12,300	124,845.00	0.18
230	600271	航天信息	11,300	123,622.00	0.18
231	688521	芯原股份	2,500	123,500.00	0.18
232	600863	内蒙华电	33,800	123,370.00	0.18
233	601866	中远海发	41,100	123,300.00	0.18
234	600208	新湖中宝	44,600	123,096.00	0.18
235	600118	中国卫星	6,100	122,488.00	0.18
236	603233	大参林	3,908	122,320.40	0.18
237	688009	中国通号	26,800	121,404.00	0.18
238	000060	中金岭南	27,100	120,866.00	0.18
239	002249	大洋电机	19,600	120,344.00	0.17
240	300677	英科医疗	4,740	120,206.40	0.17
241	300009	安科生物	11,856	119,864.16	0.17
242	601992	金隅集团	43,200	119,664.00	0.17
243	002152	广电运通	12,900	119,583.00	0.17
244	000778	新兴铸管	24,800	119,536.00	0.17
245	600066	宇通客车	13,800	119,370.00	0.17
246	002985	北摩高科	2,036	119,268.88	0.17
247	603156	养元饮品	5,200	118,144.00	0.17
248	300182	捷成股份	21,400	117,700.00	0.17
249	603658	安图生物	2,400	117,336.00	0.17
250	300070	碧水源	22,500	117,225.00	0.17
251	603858	步长制药	5,900	116,289.00	0.17
252	300168	万达信息	12,300	116,112.00	0.17
253	000401	冀东水泥	11,000	115,720.00	0.17
254	002966	苏州银行	18,970	115,717.00	0.17
255	300251	光线传媒	12,200	115,534.00	0.17
256	600998	九州通	9,700	115,527.00	0.17
257	002831	裕同科技	3,900	115,245.00	0.17

258	002191	劲嘉股份	10,700	114,704.00	0.17
259	002128	电投能源	8,000	114,560.00	0.17
260	600056	中国医药	7,700	114,114.00	0.17
261	600390	五矿资本	23,300	113,937.00	0.17
262	000997	新大陆	8,600	113,606.00	0.16
263	600970	中材国际	11,700	113,373.00	0.16
264	600667	太极实业	15,300	112,914.00	0.16
265	000021	深科技	9,700	112,908.00	0.16
266	002505	鹏都农牧	33,000	111,870.00	0.16
267	600021	上海电力	10,900	111,725.00	0.16
268	002221	东华能源	12,000	111,720.00	0.16
269	002244	滨江集团	12,900	111,585.00	0.16
270	300482	万孚生物	2,740	111,545.40	0.16
271	688002	睿创微纳	2,800	111,216.00	0.16
272	600528	中铁工业	13,800	111,090.00	0.16
273	000656	金科股份	38,700	110,682.00	0.16
274	600062	华润双鹤	4,300	110,338.00	0.16
275	600839	四川长虹	38,300	110,304.00	0.16
276	603885	吉祥航空	6,100	109,739.00	0.16
277	600827	百联股份	8,300	109,643.00	0.16
278	600297	广汇汽车	42,000	109,620.00	0.16
279	000987	越秀金控	15,590	109,597.70	0.16
280	600598	北大荒	7,400	109,224.00	0.16
281	603707	健友股份	3,870	109,134.00	0.16
282	002127	南极电商	20,400	108,936.00	0.16
283	002396	星网锐捷	4,800	108,672.00	0.16
284	002019	亿帆医药	7,700	107,646.00	0.16
285	600155	华创阳安	12,643	107,212.64	0.16
286	600201	生物股份	11,700	107,172.00	0.16
287	600498	烽火通信	7,400	107,152.00	0.16
288	002266	浙富控股	22,230	106,481.70	0.15
289	600259	广晟有色	2,100	106,365.00	0.15
290	002155	湖南黄金	8,700	105,618.00	0.15
291	000930	中粮科技	11,600	104,864.00	0.15
292	600409	三友化工	12,800	104,832.00	0.15
293	600511	国药股份	3,900	104,442.00	0.15
294	000883	湖北能源	20,400	104,244.00	0.15
295	600718	东软集团	9,000	103,590.00	0.15
296	002153	石基信息	6,500	103,155.00	0.15
297	000012	南玻 A	13,900	103,138.00	0.15
298	600755	厦门国贸	13,700	102,750.00	0.15
299	002511	中顺洁柔	8,200	102,664.00	0.15

300	002124	天邦食品	15,220	102,278.40	0.15
301	000686	东北证券	14,600	102,054.00	0.15
302	600959	江苏有线	31,100	101,386.00	0.15
303	600060	海信视像	8,100	101,250.00	0.15
304	603712	七一二	3,200	100,800.00	0.15
305	600566	济川药业	3,700	100,492.00	0.15
306	600282	南钢股份	31,900	100,485.00	0.15
307	000581	威孚高科	5,200	100,100.00	0.15
308	600782	新钢股份	19,800	99,792.00	0.14
309	600895	张江高科	8,000	99,600.00	0.14
310	601880	辽港股份	58,500	99,450.00	0.14
311	000709	河钢股份	44,000	99,440.00	0.14
312	600064	南京高科	9,000	99,000.00	0.14
313	000690	宝新能源	22,600	98,988.00	0.14
314	601179	中国西电	21,100	98,748.00	0.14
315	600022	山东钢铁	56,700	98,658.00	0.14
316	002939	长城证券	9,700	98,552.00	0.14
317	600535	天士力	9,300	97,743.00	0.14
318	300376	易事特	12,000	97,440.00	0.14
319	002701	奥瑞金	18,700	97,240.00	0.14
320	601778	晶科科技	18,000	97,200.00	0.14
321	300630	普利制药	2,759	96,978.85	0.14
322	002002	鸿达兴业	25,900	96,089.00	0.14
323	600216	浙江医药	7,000	95,550.00	0.14
324	688208	道通科技	2,900	95,468.00	0.14
325	600808	马钢股份	25,100	95,129.00	0.14
326	600500	中化国际	14,300	95,095.00	0.14
327	000598	兴蓉环境	18,600	95,046.00	0.14
328	600037	歌华有线	10,100	94,839.00	0.14
329	002532	天山铝业	14,500	94,685.00	0.14
330	600728	佳都科技	14,600	94,316.00	0.14
331	600663	陆家嘴	9,100	94,276.00	0.14
332	002468	申通快递	7,900	94,168.00	0.14
333	600567	山鹰国际	33,500	92,795.00	0.13
334	688188	柏楚电子	420	92,416.80	0.13
335	600517	国网英大	17,800	92,382.00	0.13
336	603866	桃李面包	5,544	91,753.20	0.13
337	002595	豪迈科技	4,100	91,594.00	0.13
338	002004	华邦健康	16,400	91,512.00	0.13
339	603225	新凤鸣	7,900	91,166.00	0.13
340	688006	杭可科技	1,300	91,078.00	0.13
341	601456	国联证券	7,400	90,798.00	0.13

342	002745	木林森	9,272	90,587.44	0.13
343	000785	居然之家	20,300	90,335.00	0.13
344	002429	兆驰股份	23,500	90,240.00	0.13
345	300463	迈克生物	4,400	90,156.00	0.13
346	300115	长盈精密	8,740	90,109.40	0.13
347	600597	光明乳业	7,100	89,673.00	0.13
348	300166	东方国信	9,600	88,512.00	0.13
349	688289	圣湘生物	2,980	88,237.80	0.13
350	601958	金钼股份	9,900	87,516.00	0.13
351	601860	紫金银行	30,400	87,248.00	0.13
352	603927	中科软	3,740	87,216.80	0.13
353	601106	中国一重	28,400	87,188.00	0.13
354	002390	信邦制药	12,600	87,066.00	0.13
355	300888	稳健医疗	1,300	86,450.00	0.13
356	300072	海新能科	17,000	86,020.00	0.12
357	600572	康恩贝	19,400	85,942.00	0.12
358	600398	海澜之家	17,900	85,025.00	0.12
359	601718	际华集团	27,300	84,630.00	0.12
360	601118	海南橡胶	17,700	84,606.00	0.12
361	600507	方大特钢	12,100	84,579.00	0.12
362	000540	中天金融	43,600	84,148.00	0.12
363	600582	天地科技	17,200	82,216.00	0.12
364	000937	冀中能源	11,000	82,060.00	0.12
365	600737	中粮糖业	10,900	81,968.00	0.12
366	603883	老百姓	2,418	81,921.84	0.12
367	000089	深圳机场	10,600	81,832.00	0.12
368	002048	宁波华翔	5,100	81,702.00	0.12
369	000559	万向钱潮	13,700	81,378.00	0.12
370	002368	太极股份	4,219	81,046.99	0.12
371	600967	内蒙一机	8,800	80,256.00	0.12
372	600435	北方导航	9,300	80,166.00	0.12
373	000898	鞍钢股份	24,800	79,856.00	0.12
374	600871	石化油服	42,200	79,758.00	0.12
375	601000	唐山港	30,700	79,206.00	0.11
376	001914	招商积余	4,400	79,068.00	0.11
377	002690	美亚光电	3,640	78,915.20	0.11
378	601568	北元集团	12,370	78,425.80	0.11
379	688321	微芯生物	3,100	78,089.00	0.11
380	600556	天下秀	9,400	77,362.00	0.11
381	002110	三钢闽光	12,700	77,343.00	0.11
382	000959	首钢股份	16,200	77,112.00	0.11
383	002233	塔牌集团	8,700	76,995.00	0.11

384	600195	中牧股份	6,272	76,894.72	0.11
385	601333	广深铁路	35,200	76,736.00	0.11
386	000156	华数传媒	9,600	76,512.00	0.11
387	002281	光迅科技	4,300	75,594.00	0.11
388	000537	广宇发展	5,800	75,342.00	0.11
389	600811	东方集团	26,500	74,995.00	0.11
390	003035	南网能源	11,800	74,930.00	0.11
391	002705	新宝股份	3,400	74,766.00	0.11
392	002010	传化智联	11,600	74,588.00	0.11
393	002174	游族网络	7,600	74,252.00	0.11
394	000402	金融街	12,400	73,780.00	0.11
395	600329	达仁堂	3,000	73,740.00	0.11
396	600764	中国海防	2,900	73,196.00	0.11
397	300212	易华录	4,180	72,732.00	0.11
398	600120	浙江东方	18,012	72,228.12	0.10
399	600126	杭钢股份	14,000	71,680.00	0.10
400	000488	晨鸣纸业	12,700	71,628.00	0.10
401	002416	爱施德	7,700	71,610.00	0.10
402	000990	诚志股份	6,517	71,361.15	0.10
403	600167	联美控股	9,500	71,155.00	0.10
404	601200	上海环境	6,987	70,987.92	0.10
405	000685	中山公用	9,200	70,656.00	0.10
406	600446	金证股份	6,800	70,584.00	0.10
407	603638	艾迪精密	3,440	70,520.00	0.10
408	002081	金螳螂	13,800	70,104.00	0.10
409	600373	中文传媒	7,000	69,930.00	0.10
410	002867	周大生	4,500	69,885.00	0.10
411	601098	中南传媒	7,400	69,856.00	0.10
412	600707	彩虹股份	14,900	69,732.00	0.10
413	002382	蓝帆医疗	7,300	69,715.00	0.10
414	000158	常山北明	11,600	69,600.00	0.10
415	002925	盈趣科技	3,230	69,509.60	0.10
416	601611	中国核建	8,200	68,798.00	0.10
417	001965	招商公路	9,000	68,670.00	0.10
418	002399	海普瑞	3,900	68,562.00	0.10
419	600095	湘财股份	8,900	68,441.00	0.10
420	601608	中信重工	18,000	68,220.00	0.10
421	002146	荣盛发展	22,500	68,175.00	0.10
422	600131	国网信通	5,000	67,250.00	0.10
423	002387	维信诺	10,000	67,200.00	0.10
424	000967	盈峰环境	13,200	66,792.00	0.10
425	603317	天味食品	2,340	66,619.80	0.10

426	688088	虹软科技	2,100	66,339.00	0.10
427	002948	青岛银行	18,310	66,282.20	0.10
428	600376	首开股份	13,400	65,794.00	0.10
429	000528	柳工	10,100	65,751.00	0.10
430	601187	厦门银行	10,900	64,964.00	0.09
431	600623	华谊集团	7,800	64,740.00	0.09
432	002423	中粮资本	9,600	64,416.00	0.09
433	000563	陕国投 A	20,500	63,960.00	0.09
434	603000	人民网	5,700	63,840.00	0.09
435	600901	江苏租赁	12,400	63,612.00	0.09
436	601598	中国外运	16,300	63,244.00	0.09
437	600307	酒钢宏兴	32,500	63,050.00	0.09
438	600006	东风汽车	8,300	62,665.00	0.09
439	601991	大唐发电	25,700	62,451.00	0.09
440	603650	彤程新材	1,900	61,902.00	0.09
441	300257	开山股份	4,100	61,336.00	0.09
442	688029	南微医学	700	61,040.00	0.09
443	603228	景旺电子	2,600	60,658.00	0.09
444	000961	中南建设	19,800	60,390.00	0.09
445	600717	天津港	15,044	60,326.44	0.09
446	600906	财达证券	6,700	60,233.00	0.09
447	002242	九阳股份	3,200	58,752.00	0.09
448	002434	万里扬	6,800	58,140.00	0.08
449	000718	苏宁环球	15,700	57,776.00	0.08
450	601928	凤凰传媒	7,900	56,485.00	0.08
451	000671	阳光城	25,700	56,283.00	0.08
452	000415	渤海租赁	25,600	55,552.00	0.08
453	000553	安道麦 A	4,500	54,495.00	0.08
454	600968	海油发展	21,100	54,438.00	0.08
455	601969	海南矿业	6,300	54,117.00	0.08
456	000031	大悦城	13,300	53,200.00	0.08
457	600648	外高桥	3,900	53,040.00	0.08
458	600787	中储股份	9,100	51,779.00	0.08
459	600928	西安银行	13,800	50,646.00	0.07
460	600339	中油工程	17,400	50,286.00	0.07
461	002563	森马服饰	8,400	49,728.00	0.07
462	300869	康泰医学	1,700	48,042.00	0.07
463	601228	广州港	12,800	46,976.00	0.07
464	002815	崇达技术	3,600	46,116.00	0.07
465	600835	上海机电	3,300	45,309.00	0.07
466	688819	天能股份	1,300	44,954.00	0.07
467	000028	国药一致	1,500	44,685.00	0.06



468	600377	宁沪高速	5,100	43,707.00	0.06
469	603056	德邦股份	3,200	42,976.00	0.06
470	002945	华林证券	2,800	42,700.00	0.06
471	000062	深圳华强	3,300	41,910.00	0.06
472	601139	深圳燃气	6,000	41,640.00	0.06
473	000869	张裕 A	1,400	41,636.00	0.06
474	603379	三美股份	1,860	41,385.00	0.06
475	000717	韶钢松山	11,800	41,300.00	0.06
476	600299	安迪苏	4,200	40,236.00	0.06
477	601869	长飞光纤	1,300	40,196.00	0.06
478	601298	青岛港	7,300	39,931.00	0.06
479	603868	飞科电器	500	37,875.00	0.05
480	300741	华宝股份	1,300	36,166.00	0.05
481	001872	招商港口	2,300	35,880.00	0.05
482	601156	东航物流	1,800	35,640.00	0.05
483	002653	海思科	2,200	35,442.00	0.05
484	600823	世茂股份	11,700	34,866.00	0.05
485	600927	永安期货	1,700	34,289.00	0.05
486	600350	山东高速	6,500	34,125.00	0.05
487	601828	美凯龙	5,600	33,936.00	0.05
488	001227	兰州银行	6,500	31,980.00	0.05
489	603786	科博达	500	30,785.00	0.04
490	603355	莱克电气	1,180	29,771.40	0.04
491	603515	欧普照明	1,600	27,920.00	0.04
492	001203	大中矿业	2,300	25,990.00	0.04
493	601665	齐鲁银行	5,200	25,376.00	0.04
494	002946	新乳业	1,800	23,382.00	0.03
495	603719	良品铺子	800	22,904.00	0.03
496	601003	柳钢股份	5,300	21,465.00	0.03
497	002901	大博医疗	500	19,570.00	0.03
498	600956	新天绿能	1,500	18,480.00	0.03
499	603983	丸美股份	500	13,400.00	0.02
500	600917	重庆燃气	1,800	12,996.00	0.02

### 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.05

### 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	300769	德方纳米	416,364.00	0.63
2	600096	云天化	403,881.00	0.61
3	300012	华测检测	390,052.00	0.59
4	002497	雅化集团	379,907.00	0.57
5	002240	盛新锂能	371,370.00	0.56
6	300390	天华超净	321,699.00	0.49
7	002407	多氟多	312,977.00	0.47
8	688180	君实生物	305,079.00	0.46
9	300073	当升科技	286,806.00	0.43
10	601058	赛轮轮胎	283,398.00	0.43
11	002756	永兴材料	281,600.00	0.43
12	688122	西部超导	263,556.06	0.40
13	601108	财通证券	253,327.00	0.38
14	688777	中控技术	248,801.00	0.38
15	000783	长江证券	233,303.00	0.35
16	601162	天风证券	230,831.00	0.35
17	600499	科达制造	229,403.00	0.35
18	601696	中银证券	228,040.00	0.34
19	002625	光启技术	212,382.00	0.32
20	603345	安井食品	211,267.00	0.32

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	000733	振华科技	513,223.00	0.78
2	002340	格林美	439,447.00	0.66
3	600188	兖矿能源	422,056.00	0.64
4	000723	美锦能源	352,113.00	0.53
5	601117	中国化学	346,177.00	0.52
6	688005	容百科技	342,729.05	0.52
7	300751	迈为股份	307,318.00	0.46
8	600884	杉杉股份	296,832.20	0.45
9	002013	中航机电	283,578.00	0.43
10	601689	拓普集团	281,140.00	0.42
11	605358	立昂微	276,998.92	0.42
12	600754	锦江酒店	264,484.00	0.40
13	300763	锦浪科技	236,839.00	0.36
14	300223	北京君正	209,037.00	0.32
15	600733	北汽蓝谷	187,057.00	0.28
16	002080	中材科技	178,453.00	0.27

17	600803	新奥股份	175,921.00	0.27
18	603290	斯达半导	170,474.00	0.26
19	688536	思瑞浦	164,633.94	0.25
20	603893	瑞芯微	159,897.00	0.24

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	17,793,898.83
卖出股票收入（成交）总额	12,772,610.07

#### 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）	4,000.75	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,000.75	0.01

#### 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	127064	杭氧转债	40	4,000.75	0.01

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货，无相关投资政策。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围未包括国债期货，无相关投资政策。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金投资范围未包括国债期货，无相关投资政策。

## 7.12 投资组合报告附注

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

本报告编制日前一年以内，本基金持有的“中天科技”的发行主体江苏中天科技股份有限公司于 2022 年 1 月 11 日收到上海证券交易所上证公监函（2021）0168 号；经查，2021 年 10 月 31 日，公司工作人员以电话会议形式召开机构调研会与机构投资者交流季报业绩，提及部分板块业务订单量与预测性数据，上述相关信息应当根据规则由公司在符合中国证监会规定的指定媒体上真实、准确、完整地披露，公司相关信息披露不公平，信息披露管理制度存在缺陷，违反了《上海证券交易所股票上市规则》第 2.1 条、第 2.4 条、第 2.15 条等有关规定，予以监管警示。于 2022 年 6 月 20 日收到上海证券交易所上证公监函（2022）0078 号；经查，公司高端通信业务收入确认由“总额法”变更为“净额法”，并采用追溯重述法对 2019 年度、2020 年度的财务数据进行追溯调整、对 2021 年 1 至 9 月数据进行更正，调减营业收入和营业成本，公司会计核算和会计处理存在差错，导致多期定期报告相关财务信息披露不准确，其行为违反了《公开发行证券的公司信息披露编报规则第 15 号——财务报告的一般规定》《上海证券交易所股票上市规则》（2020 年修订）第 1.4 条、第 2.1 条、第 2.5 条等有关规定，予以监管警示。本基金持有的“盛新锂能”的发行主体盛新锂能集团股份有限公司于 2021 年 9 月 3 日收到深圳证券交易所关于《对深圳盛新锂能集团股份有限公司及相关当事人给予纪律处分的决定》；经查，公司财务会计报告存在重大会计差错，对 2009 年度至 2012 年度、2018 年度报告相关财务数据进行更正，其中对 2018 年净利润调整金额为-4,350.12 万元，变动幅度达 40.14%；公司以资金拆借方式对外提供财务资助，未及时履行审批程序和信息披露义务，上述行为违反了本所《股票上市规则（2018 年 11 月修订）》第 1.4 条、第 2.1 条，以及《中小企业板规范运作指引（2015 年修订）》第 7.4.3 条、第 7.4.4 条的规定，给予通报批评的处分。于 2022 年 6 月 8 日收到深圳证券交易所《关于对盛新锂能集团股份有限公司的监管函》（公司部监管函（2022）第 115 号）；经查，公司提供财务资助，未及时履行董事会审议程序及信息披露义务；公司出售参股公司关联交易金额 3.55 亿元，占 2020 年经审计净资产的 11.03%，交易标的财务数据截止日为 2020 年 9 月 30 日且未经审计。上述行为违反了本所《股票上市规则（2020 年修订）》第 1.4 条、第 2.1 条、第 10.2.5 条，《上市公司规范运作

指引（2020 年修订）》第 6.2.3 条，《股票上市规则（2022 年修订）》第 1.4 条、第 2.1.1 条，以及《上市公司自律监管指引第 1 号——主板上市公司规范运作》第 6.1.3 条的规定，公司董事会应充分重视上述问题，吸取教训，杜绝上述问题的再次发生。

本基金管理人将密切跟踪相关进展，在严格遵守法律法规和基金合同基础上进行投资决策。

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

#### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	4,376.71
2	应收清算款	-
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	75,616.24
8	其他	-
9	合计	79,992.95

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的股票。

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的股票。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

#### 8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
360	148,516.89	50,068,580.00	93.65	3,397,500.00	6.35

#### 8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
联接基金	43,014,980.00	80.45

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	创金合信基金—中国 银行—创金合信鼎泰 34号集合资产管理计 划	7,003,600.00	13.10
2	刘英虹	250,000.00	0.47
3	曾雨清	190,000.00	0.36
4	龚俐	120,000.00	0.22
5	李向阳	116,300.00	0.22
6	冯世彦	114,400.00	0.21
7	胡汉明	100,500.00	0.19
8	邹天翼	100,000.00	0.19
9	李劲松	91,600.00	0.17
10	钱中明	90,300.00	0.17
11	招商银行股份有限公司—中银证券中证 500 交易型开放式指数证 券投资基金联接基金	43,014,980.00	80.45

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	1,000.00	0.0019

### 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

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020 年 4 月 30 日） 基金份额总额	251,466,080.00
本报告期期初基金份额总额	45,466,080.00
本报告期基金总申购份额	10,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	2,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	53,466,080.00

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2022 年 1 月，张静董事和张丽娜监事因工作安排原因提交辞职报告。2022 年 4 月 20 日，林景臻董事长因工作安排原因提交辞职报告，同日召开的董事会选举宁敏董事为公司新董事长。2022 年 6 月，何涛监事分别由监事会提名、股东大会选举产生。6 月 29 日，徐朝莹监事会主席因工作安排原因提交辞职报告，同日召开的监事会选举何涛监事为公司新监事会主席。2022 年 4 月，沈奕先生不再担任中银国际证券股份有限公司投资银行板块管理委员会主席，公司执行委员会委员；2022 年 5 月，中银国际证券股份有限公司聘任葛浩为公司业务总监；聘任赵向雷为公司业务总监，解聘其公司风险总监职务；刘国强兼任公司董事会秘书。

本报告期，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

一、本报告期内，本基金管理人无涉及基金管理业务的诉讼，公司其他主要诉讼、仲裁事项请参见《中银国际证券股份有限公司 2022 年半年度报告》；

二、本报告期内，无涉及基金财产的诉讼事项；

三、本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

未有管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中银证券	6	30,420,044.57	100.00	22,250.19	100.00	-

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

2、今后基金专用交易席位的选择标准如下：

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

3、今后基金专用交易席位的选择程序如下：

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

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

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



中银证券	32,735.96	100.00	-	-	-	-
------	-----------	--------	---	---	---	---

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

2、今后基金专用交易席位的选择标准如下：

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

3、今后基金专用交易席位的选择程序如下：

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

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中银国际证券股份有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、上交所、深交所、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2022年1月12日
2	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	上交所、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2022年1月22日
3	中银国际证券股份有限公司旗下基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、上交所、深交所、公司官网	2022年1月22日
4	中银国际证券股份有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资上交所上市股票的风险提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、上交所、深交所、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2022年1月22日
5	中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年年度报告	上交所、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2022年3月30日
6	中银证券中证 500 交易型开放式指数	上交所、公司官网及中	2022年4月23日

	证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站	
7	中银国际证券股份有限公司关于旗下管理的上海证券交易所上市 ETF 实施申赎业务多码合一的公告	上交所、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 6 月 18 日

注：全部公告均在公司网站披露，部分公告在公司网站及报纸披露。

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20220101-20220630	34,860,500.00	11,093,180.00	2,938,700.00	43,014,980.00	80.4500

#### 产品特有风险

本基金由于存在单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况，如遇市场行情突变可能存在大额赎回甚至巨额赎回的风险，增加基金管理人的流动性管理压力。同时，基金管理人应付赎回的变现行为可能使基金资产净值受到不利影响或者产生较大波动。本基金管理人后期将审慎评估大额申购对基金持有集中度的影响，避免单一投资者集中度继续提高，同时将完善流动性风险风险管控机制，加强对基金持有人利益的保护。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予本基金募集注册的文件
- 2、基金合同
- 3、托管协议
- 4、法律意见书
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 7、中国证监会要求的其他文件

## 12.2 存放地点

除第 6 项在基金托管人处外，其余文件均在基金管理人的住所。

## 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

中银国际证券股份有限公司

2022 年 8 月 30 日