

# 中融中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

## 2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人:国联基金管理有限公司

基金托管人:中国光大银行股份有限公司

送出日期:2023 年 08 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、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。本中期报告已经全体独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年8月25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2023年01月01日起至2023年06月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
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	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	21
§7 投资组合报告	43
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股票投资明细	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	61
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	63
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	63
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	63
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	63
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	63
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	64
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	64
7.12 投资组合报告附注	64
§8 基金份额持有人信息	65
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
8.2 期末上市基金前十名持有人	65

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	66
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.....	66
§9 开放式基金份额变动.....	66
§10 重大事件揭示.....	67
10.1 基金份额持有人大会决议.....	67
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.....	67
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	67
10.4 基金投资策略的改变.....	67
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	67
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.....	67
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	67
10.8 其他重大事件.....	69
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	69
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.....	69
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	70
§12 备查文件目录.....	70
12.1 备查文件目录.....	70
12.2 存放地点.....	70
12.3 查阅方式.....	70

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中融中证500交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	中融中证500ETF
场内简称	中融500（基金扩位简称：中融中证500ETF）
基金主代码	515550
基金运作方式	交易型开放式（ETF）
基金合同生效日	2019年11月15日
基金管理人	国联基金管理有限公司
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	25,345,700.00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	2019年12月25日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构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（如流动性不足、成份股长期停牌、法律法规限制等）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，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使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	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为

	指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
--	-----------------------------------------------------------

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国联基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周妹云	石立平
	联系电话	010-56517000	010-63639180
	电子邮箱	zhoumeiyun@gfund.com	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		400-160-6000; 010-56517299	95595
传真		010-56517001	010-63639132
注册地址		深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路3086号大百汇广场31层02-04单元	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		北京市东城区安定门外大街208号中粮置地广场A座11层	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码		100011	100033
法定代表人		王瑶	王江

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.gfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

### 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 (2023年01月01日- 2023年06月30日)
本期已实现收益	-186,360.41
本期利润	1,287,503.48
加权平均基金份额本期利润	0.0488
本期加权平均净值利润率	3.69%
本期基金份额净值增长率	3.34%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023年06月30日)
期末可供分配利润	7,373,410.88
期末可供分配基金份额利润	0.2909
期末基金资产净值	32,719,110.88
期末基金份额净值	1.2909
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023年06月30日)
基金份额累计净值增长率	29.09%

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、期末可供分配利润为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	业绩比较 基准收益	业绩比较 基准收益	①-③	②-④

		准差②	率③	率标准差④		
过去一个月	-0.24%	0.90%	-0.81%	0.93%	0.57%	-0.03%
过去三个月	-4.34%	0.80%	-5.38%	0.83%	1.04%	-0.03%
过去六个月	3.34%	0.76%	2.29%	0.79%	1.05%	-0.03%
过去一年	-4.95%	0.93%	-7.06%	0.96%	2.11%	-0.03%
过去三年	9.34%	1.16%	2.29%	1.19%	7.05%	-0.03%
自基金合同生效起至今	29.09%	1.21%	22.12%	1.27%	6.97%	-0.06%

### 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

中融中证500交易型开放式指数证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2019年11月15日-2023年06月30日)



注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

## §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



本基金管理人为国联基金管理有限公司，成立于2013年5月31日，由国联证券股份有限公司与上海融晟投资有限公司共同出资，注册资金7.5亿元人民币。截至2023年6月30日，国联基金管理有限公司共管理82只基金，包括中融货币市场基金、中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金、中融新机遇灵活配置混合型证券投资基金、中融鑫起点灵活配置混合型证券投资基金、中融国证钢铁行业指数型证券投资基金、中融中证煤炭指数型证券投资基金、中融新经济灵活配置混合型证券投资基金、中融日日盈交易型货币市场基金、中融产业升级灵活配置混合型证券投资基金、中融竞争优势股票型证券投资基金、中融现金增利货币市场基金、中融恒泰纯债债券型证券投资基金、中融上海清算所银行间1-3年中高等级信用债指数发起式证券投资基金、中融鑫思路灵活配置混合型证券投资基金、中融物联网主题灵活配置混合型证券投资基金、中融盈泽中短债债券型证券投资基金、中融恒信纯债债券型证券投资基金、中融睿祥纯债债券型证券投资基金、中融核心成长灵活配置混合型证券投资基金、中融沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金、中融聚商3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金、中融季季红定期开放债券型证券投资基金、中融智选红利股票型证券投资基金、中融聚安3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融医疗健康精选混合型证券投资基金、中融聚业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融恒裕纯债债券型证券投资基金、中融聚明3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融恒惠纯债债券型证券投资基金、中融央视财经50交易型开放式指数证券投资基金、中融央视财经50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中融策略优选混合型证券投资基金、中融恒鑫纯债债券型证券投资基金、中融聚汇3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融高股息精选混合型证券投资基金、中融睿享86个月定期开放债券型证券投资基金、中融中证500交易型开放式指数证券投资基金、中融聚通3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融睿嘉39个月定期开放债券型证券投资基金、中融中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中融恒安纯债债券型证券投资基金、中融智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、中融品牌优选混合型证券投资基金、中融中债1-5年国开行债券指数证券投资基金、中融聚锦一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中融融慧双欣一年定期开放债券型证券投资基金、中融价值成长6个月持有期混合型证券投资基金、中融创业板两年定期开放混合型证券投资基金、中融成长优选混合型证券投资基金、中融景瑞一年持有期混合型证券投资基金、中融产业趋势一年定期开放混合型证券投资基金、中融景颐6个月持有期混合型证券投资基金、中融行业先锋6个月持有期混合型证券投资基金、中融鑫锐研究精选一年持有期混合型证券投资基金、中融景盛一年持有期混合型证券投资基金、中融恒益纯债债券型证券投资基金、中融恒阳纯债债券型证券投资基金、中融低碳经济3个月持有期混合型证券投资基金、中融景泓一年持有期混合型证券投资基金、中融金融鑫选3个月持有期混合型证券投资基金、中融匠心优选混合型证券投资基金、中融恒利纯债债券型证券

投资基金、中融添益进取3个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、中融高质量成长混合型证券投资基金、中融景惠混合型证券投资基金、中融聚优一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中融恒泽纯债债券型证券投资基金、中融研发创新混合型证券投资基金、中融优势产业混合型证券投资基金、中融医药消费混合型证券投资基金、中融成长先锋一年持有期混合型证券投资基金、中融益海30天滚动持有短债债券型证券投资基金、中融益泓90天滚动持有债券型证券投资基金、中融兴鸿优选一年封闭运作混合型证券投资基金、中融恒通纯债债券型证券投资基金、中融融盛双盈一年封闭运作债券型证券投资基金、中融养老目标日期2045三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、中融中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、中融恒润纯债债券型证券投资基金、中融添安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)、中融消费精选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		
赵菲	中融国证钢铁行业指数型证券投资基金、中融中证煤炭指数型证券投资基金、中融央视财经50交易型开放式指数证券投资基金、中融央视财经50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中融中证500交易型开放式指数证券投资基金、中融中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中融智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、中融智选红利股票型证券投资基金、中	2019-1 1-15	-	14	赵菲先生，中国国籍，毕业于北京师范大学概率论与数理统计专业，研究生、硕士学位，具有基金从业资格，证券从业年限14年。2008年8月至2011年5月曾任国泰君安证券股份有限公司证券及衍生品投资总部投资经理；2011年5月至2012年11月曾任嘉实基金管理有限公司结构产品投资部专户投资经理。2012年11月加入本公司，现任数量投资部总经理。

	融物联网主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理及数量投资部总经理。				
陈薪羽	中融央视财经50交易型开放式指数证券投资基金、中融央视财经50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中融中证500交易型开放式指数证券投资基金、中融中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中融智选红利股票型证券投资基金的基金经理。	2019-11-28	-	7	陈薪羽先生，中国国籍，毕业于北京大学概率论与数理统计专业，研究生、硕士学位，具有基金从业资格，证券从业年限7年。2015年8月至2016年10月任中国人保寿险首席投资官秘书。2016年10月加入本公司，现任数量投资部基金经理。

注：（1）上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写；基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

（2）证券基金从业的含义遵从《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

报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项配套法规、基金合同和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，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

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司制定了《公平交易管理办法》并严格执行。公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节

的内部控制，在研究、决策、交易执行等各环节，通过制度、流程、技术手段等各方面措施确保了公平对待所管理的投资组合，保证公平交易原则的实现。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生不公平的交易事项。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量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

本基金作为一只投资于中证500指数的被动型产品，我们采取完全复制的被动投资策略，运用智能指数投资系统进行精细化管理，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，严格控制本基金的跟踪偏离度和跟踪误差，给投资者提供一个标准化的中证500指数的投资工具。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中融中证500ETF基金份额净值为1.2909元，本报告期内，基金份额净值增长率为3.34%，同期业绩比较基准收益率为2.29%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年回顾：上半年经济状况及市场预期，整体上就是从“强预期，弱现实”转为“弱预期，弱现实”。在疫情全面放开的背景下，年初各大金融机构预测方向指向“中国复苏”，方向正确但实际进程比较波折。市场方面，从去年开始基金销售乏力，市场缺乏增量资金，外资流出，市场基本面属性在弱化，博弈属性显著提升，主题投资风格持续跑赢。

下半年展望：结合7月政治局会议释放的积极因素，市场对下半年政策预期加强，从会议提出的政策组合“扩内需、提信心、防风险”来看，政府经济托举的意愿加强。“扩内需”主要从消费、基建、民间投资等多点发力，地产则放在“防风险”里，属于托举性政策而不是刺激。我们总体判断下半年经济弱复苏的基调可能不变，基于以下几方面理由：一是地方政府债务压力仍然较大，财政空间有限；二是工业去库存预计在下半年持续；三是居民预防性储蓄仍较为明显；四是两会经济目标不高。整体来看，弱复苏也是复苏，市场预期已经开始发生扭转，下半年应当对市场保持适度乐观。

重点关注几条投资主线，一是“顺周期+超跌股”的估值修复逻辑，看好包括建筑（一带一路十周年订单的确定性）、钢铁、有色和半导体（库存周期中低库存等待需求回暖），随着后续政策落地的阶段，经济微观层面的改善或将提振相关板块的估值；二是看好出口链上部分行业的机会，如家电、家居、汽车、消费电子、机械等领域，这些也是政策托举和内外需共振的重要领域；三是AI产业链（算力、应用）涉及到的科技成长主题经过去伪存真和充分调整后，仍有投资机会。

本基金将积极应对各种因素对指数跟踪效果带来的冲击，努力将跟踪误差控制在基金合同规定的范围内，力争使投资者充分获得指数的长期收益。

#### 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、中国证券投资基金业协会相关指引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。本基金管理人制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；设立估值委员会，估值委员会成员由具有专业胜任能力和相关工作经历的高级管理人员、投资研究部门、基金运营部门、风险管理部门、法律合规部门人员组成，负责研究、指导基金估值业务，基金经理根据公司制度参加估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务；使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则及具体估值程序；估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。本基金日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，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。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。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 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

本报告期内，本基金存在连续60个工作日基金资产净值低于5000万元的情形。针对该情形，本基金管理人已向中国证监会报告了解决方案。

## §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中融中证500交易型开放式指数证券投资基金（以下称“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、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支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，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

## 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依法对基金管理人编制的《中融中证500交易型开放式指数证券投资基金2023年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

## §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：中融中证500交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	2,000,548.83	1,449,534.23
结算备付金		548,947.20	478,619.72
存出保证金		144,920.67	174,913.57
交易性金融资产	6.4.7.2	30,092,122.65	32,106,394.93

其中：股票投资		30,083,423.83	32,044,758.76
基金投资		-	-
债券投资		8,698.82	61,636.17
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		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	48,083.51
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		32,786,539.35	34,257,545.96
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年06月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<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		3,345.25	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		8,089.44	8,937.03

应付托管费		2,696.47	2,979.00
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	6.4.7.6	53,297.31	86,001.61
负债合计		67,428.47	97,917.64
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	25,345,700.00	27,345,700.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	7,373,410.88	6,813,928.32
净资产合计		32,719,110.88	34,159,628.32
负债和净资产总计		32,786,539.35	34,257,545.96

注：报告截止日2023年06月30日，基金份额总额25,345,700.00份，份额净值1.2909元。

## 6.2 利润表

会计主体：中融中证500交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至202 2年06月30日
一、营业总收入		1,396,753.19	-2,868,260.05
1.利息收入		10,250.64	9,543.14
其中：存款利息收入	6.4.7.9	10,250.64	9,543.14
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		-	-
证券出借利息收入		-	-



其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-87,990.58	-296,599.70
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-450,441.27	-327,052.84
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	8,397.45	1,031.80
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-2,485.03	-225,843.54
股利收益	6.4.7.16	356,538.27	255,264.88
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）	6.4.7.17	1,473,863.89	-2,596,083.13
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.18	629.24	14,879.64
<b>减：二、营业总支出</b>		109,249.71	61,285.20
1. 管理人报酬		51,902.25	35,838.34
2. 托管费		17,300.80	11,946.03
3. 销售服务费		-	-
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	6.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		144.28	-
8. 其他费用	6.4.7.20	39,902.38	13,500.83

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,287,503.48	-2,929,545.25
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,287,503.48	-2,929,545.25
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,287,503.48	-2,929,545.25

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中融中证500交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06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）	27,345,700.00	-	6,813,928.32	34,159,628.32
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）	27,345,700.00	-	6,813,928.32	34,159,628.32
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,000,000.00	-	559,482.56	-1,440,517.44
（一）、综合收益总额	-	-	1,287,503.48	1,287,503.48
（二）、本期基	-2,000,000.00	-	-728,020.92	-2,728,020.92

金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)				
其中: 1.基金申购款	-	-	-	-
2.基金赎回款	-2,000,000.00	-	-728,020.92	-2,728,020.92
(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)	25,345,700.00	-	7,373,410.88	32,719,110.88
项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06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)	19,345,700.00	-	10,107,857.68	29,453,557.68
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净	19,345,700.00	-	10,107,857.68	29,453,557.68

资产（基金净值）				
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-	-3,180,899.50	-3,180,899.50
（一）、综合收益总额	-	-	-2,929,545.25	-2,929,545.25
（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）	-	-	-251,354.25	-251,354.25
其中：1.基金申购款	2,000,000.00	-	525,347.23	2,525,347.23
2.基金赎回款	-2,000,000.00	-	-776,701.48	-2,776,701.48
（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）	19,345,700.00	-	6,926,958.18	26,272,658.18

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：

王瑶

黄庆

李克

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中融中证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]1304号文《关于准予中融中证500交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》批准,由国联基金管理有限公司(原中融基金管理有限公司)依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《中融中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》("基金合同")发起,于2019年11月15日募集成立。本基金的基金管理人为国联基金管理有限公司(原中融基金管理有限公司),基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

本基金募集期为2019年9月3日至2019年11月8日,本基金为交易型开放式基金,存续期限不定,本基金共募集有效净认购资金235,339,130.00元,折合235,339,130.00份中融500基金份额。有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币6,570.00元,折合6,570份中融500基金份额,以上收到的实收基金共计人民币235,345,700.00元,折合235,345,700份中融500基金份额,有效认购户数为3637户。本基金募集资金经上会会计师事务所(特殊普通合伙)验资。

根据《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》和基金合同等有关规定,本基金主要投资于标的指数即中证500指数成份股和备选成份股。为更好地实现基金的投资目标,本基金还可投资于国内依法发行上市的非成份股(包括中小板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准上市或同意注册的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券等)、货币市场工具、债券回购、资产支持证券、银行存款、股指期货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)。

本基金业绩比较基准为中证500指数收益率。

### 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颁布的《企业会计准则--基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称"企业会计准则")编制,同时,在信息披露和估值方面,也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计

报表附注的编制及披露》、《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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以基金持续经营为基础列报。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2023年06月30日的财务状况以及2023年半年度的经营成果和基金净值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**

无。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

无。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

无。

#### **6.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局国家税务总局财税[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局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号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、财税[2016]46号文《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号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税

暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》及其他相关税务法规和实务操作，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。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2、对证券投资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，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

3、对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴个人所得税，个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4、对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5、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。

6、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免于缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

7、本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费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 2023年06月30日
----	--------------------

活期存款	2,000,548.83
等于：本金	2,000,149.14
加：应计利息	399.69
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	2,000,548.83

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	31,206,304.41	-	30,083,423.83	-1,122,880.58	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	6,000.00	7.22	8,698.82	2,691.60
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	6,000.00	7.22	8,698.82	2,691.60
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	



合计	31,212,304.41	7.22	30,092,122.65	-1,120,188.98
----	---------------	------	---------------	---------------

### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	1,187,400.00	-	-	-
--股指期货	1,187,400.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,187,400.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为零。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益。因此，衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的股指期货暂收暂付款(结算所得的持仓损益)抵销后无余额。

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2312	中证500股指期货2312合约	1.00	1,184,840.00	-2,560.00
合计				-2,560.00
减：可抵销 期货暂收 款				-2,560.00
净额				-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

### 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：无。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

#### 6.4.7.5 其他资产

注：无。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023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	8,584.36	
其中：交易所市场	8,584.36	
银行间市场	-	
应付利息	-	
预提费用-审计费	9,916.99	
预提费用-信息披露费	24,795.19	
应付指数使用费	10,000.77	
合计	53,297.31	

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
	上年度末	27,345,700.00
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-2,000,000.00	-2,000,000.00

本期末	25,345,700.00	25,345,700.00
-----	---------------	---------------

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

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	17,298,279.67	-10,484,351.35	6,813,928.32
本期利润	-186,360.41	1,473,863.89	1,287,503.48
本期基金份额交易产生的变动数	-1,269,961.49	541,940.57	-728,020.92
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-1,269,961.49	541,940.57	-728,020.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,841,957.77	-8,468,546.89	7,373,410.88

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
活期存款利息收入	5,700.88
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	4,505.35
其他	44.41
合计	10,250.64

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-440,204.37

股票投资收益——赎回差价收入	-10,236.90
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	-450,441.27

#### 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
卖出股票成交总额	7,827,738.83
减：卖出股票成本总额	8,248,813.38
减：交易费用	19,129.82
买卖股票差价收入	-440,204.37

#### 6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
赎回基金份额对价总额	2,728,020.92
减：现金支付赎回款总额	1,357,038.92
减：赎回股票成本总额	1,381,218.90
减：交易费用	-
赎回差价收入	-10,236.90

#### 6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 6.4.7.11 基金投资收益

注：无。

#### 6.4.7.12 债券投资收益

##### 6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
债券投资收益——利息收入	11.22
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	8,386.23
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	8,397.45

#### 6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	57,415.50
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	49,000.00
减：应计利息总额	26.97
减：交易费用	2.30
买卖债券差价收入	8,386.23

#### 6.4.7.13 资产支持证券投资收益

注：无。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

##### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益--买卖贵金属差价收入

注：无。

**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 衍生工具收益——其他投资收益**

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2023年01月01日至2023年06月30日
期货投资	-2,485.03

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	356,538.27
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	356,538.27

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
1.交易性金融资产	1,430,103.89
——股票投资	1,434,025.49
——债券投资	-3,921.60
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	43,760.00
——权证投资	-
——期货投资	43,760.00
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	1,473,863.89

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
基金赎回费收入	-
ETF基金替代损益	629.24
合计	629.24

注：替代损益收入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。

**6.4.7.19 信用减值损失**

注：无。

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
审计费用	9,916.99
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-
指数使用费	5,190.20
合计	39,902.38

**6.4.7.21 分部报告**

无。

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 或有事项**

无。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于2023年8月3日发布了《关于公司法定名称、住所变更的公告》，公司名称由“中融基金管理有限公司”变更为“国联基金管理有限公司”。除以上情况外，本基金无其他需要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

2023年5月6日，本基金管理人发布《中融基金管理有限公司关于公司股东及实际控制人变更的公告》，根据中国证券监督管理委员会证监许可[2023]848号文核准，国联证券股份有限公司依法受让中融基金管理有限公司（以下简称“本公司”）75.5%股权，成为本公司主要股东，无锡市国联发展（集团）有限公司成为本公司实际控制人。本次股权变更后，本公司的注册资本保持不变，本公司的股权结构如下：

国联证券股份有限公司75.5%；上海融晟投资有限公司24.5%。本公司股权变更工商变更登记手续已办理完毕。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国联基金管理有限公司（原中融基金管理有限公司）	基金管理人、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司	基金托管人
国联证券股份有限公司	基金管理人股东（2023年5月5日后）
中融国际信托有限公司	基金管理人股东（2023年5月5日前）
上海融晟投资有限公司	基金管理人股东
国联（北京）资产管理有限公司（原中融（北京）资产管理有限公司）	基金管理人子公司
中融中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“中融中证500ETF联接”）	基金管理人管理的其他基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易



**6.4.10.1.1 股票交易**

注：无。

**6.4.10.1.2 权证交易**

注：无。

**6.4.10.1.3 债券交易**

注：无。

**6.4.10.1.4 债券回购交易**

注：无。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

注：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 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	51,902.25	35,838.34
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：①支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值的年费率计提，每日计提，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×0.30%/当年天数。

②客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023	上年度可比期间 2022年01月01日至2022
----	------------------------	-----------------------------

	年06月30日	年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	17,300.80	11,946.03

注：①支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值的年费率计提，每日计提，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 $\times$ 0.10%/当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

##### 6.4.10.4.2 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 2023年06月30日		上年度末 2022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
中融中证500ETF联接	21,826,700.00	86.12%	22,796,700.00	83.36%

注：除基金管理人之外的其他关联方持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

#### 6.4.10.5 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 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022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	2,000,548.83	5,700.88	1,349,824.11	5,547.06

有限公司				
------	--	--	--	--

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。本基金用于证券交易结算的资金通过托管人托管结算资金专用存款账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

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

注：无。

#### 6.4.12 期末（2023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

注：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
601298	青岛港	2023-06-28	重大事项停牌	6.97	2023-07-03	7.40	3,200	17,948.82	22,304.00	-

##### 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：无。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

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

本基金的基金管理人实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节，构建了分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，形成了由四大防线共同筑成的风险管理体系。本基金管理人的各个业务部门为第一道防线，各业务部门总监作为风险责任人，负责制订本部门的作业流程以及风险控制措施；公司专属风险管理部门法律合规部和风险管理部为第二道防线，负责对公司业务的法律合规风险、投资管理风险和运作风险进行监控管理；公司经营管理层和公司内控及风险管理委员会为第三道防线，负责对风险状况进行全面监督并及时制定相应的对策和实施监控措施；董事会下属的风险与合规委员会为第四道防线，负责审查公司对公司内外部风险识别、评估和分析等情况，及公司内部控制、风险管理政策、风险管理制度的执行情况等。

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的发行人出现违约、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。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的信用评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

按信用评级列示的债券、资产支持证券和同业存单的投资情况如下表所示，如无表格，则本基金于本期末及上年度末未持有除国债、地方政府债、政策性金融债、央行票据以外的债券。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

#### 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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	-	7,025.87
AAA以下	8,698.82	54,610.30
未评级	-	-
合计	8,698.82	61,636.17

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、地方政府债、政策性金融债、央行票据。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注6.4.12.3中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在1个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合同到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 0 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	2,000,548.83	-	-	-	2,000,548.83
结算备付金	548,947.20	-	-	-	548,947.20
存出保证金	144,920.67	-	-	-	144,920.67
交易性金融资产	8,698.82	-	-	30,083,423.83	30,092,122.65
资产总计	2,703,115.52	-	-	30,083,423.83	32,786,539.35
负债					
应付清算款	-	-	-	3,345.25	3,345.25
应付管理人报酬	-	-	-	8,089.44	8,089.44
应付托管费	-	-	-	2,696.47	2,696.47
其他负债	-	-	-	53,297.31	53,297.31
负债总计	-	-	-	67,428.47	67,428.47
利率敏感度缺口	2,703,115.52	-	-	30,015,995.36	32,719,110.88
上年度末 2022 年 1 2 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	1,449,534.23	-	-	-	1,449,534.23
结算备付金	478,619.72	-	-	-	478,619.72
存出保证金	174,913.57	-	-	-	174,913.57
交易性	61,636.17	-	-	32,044,758.76	32,106,394.93

金融资产					
应收清算款	-	-	-	48,083.51	48,083.51
资产总计	2,164,703.69	-	-	32,092,842.27	34,257,545.96
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	8,937.03	8,937.03
应付托管费	-	-	-	2,979.00	2,979.00
其他负债	-	-	-	86,001.61	86,001.61
负债总计	-	-	-	97,917.64	97,917.64
利率敏感度缺口	2,164,703.69	-	-	31,994,924.63	34,159,628.32

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的情况下，利率发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值可参考的公允价值产生的影响。本基金于本报告期末未持有债券投资或持有的债券投资占比并不重大，因而市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

#### 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，无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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。本基金主要投资于上市交易的证券，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。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。



## 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 2023年06月30日		上年度末 2022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	30,083,423.83	91.94	32,044,758.76	93.81
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	8,698.82	0.03	61,636.17	0.18
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	30,092,122.65	91.97	32,106,394.93	93.99

## 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、估测组合市场价格风险的敏感性为考察沪深300指数变动时，因股票资产变动导致对基金资产净值的影响金额；		
	2、假定沪深300指数变化5%，其他市场变量不变；		
	3、Beta系数是根据组合在过去一年的净值数据和沪深300指数数据回归得出，对于成立不足一年的组合，取自成立以来的数据计算。		
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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
	沪深300指数上升5%	1,252,535.18	1,527,364.65

	沪深300指数下降5%	-1,252,535.18	-1,527,364.65
--	-------------	---------------	---------------

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

## 6.4.14 公允价值

### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

本基金以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债，其公允价值计量基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，被划分为三个层次：

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次输入值是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。

第三层次输入值是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

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	30,069,818.65	31,977,499.85
第二层次	22,304.00	128,895.08
第三层次	-	-
合计	30,092,122.65	32,106,394.93

#### 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。

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

**6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

**6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明**

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

**6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

无。

**§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	30,083,423.83	91.76
	其中：股票	30,083,423.83	91.76
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	8,698.82	0.03
	其中：债券	8,698.82	0.03
	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	2,549,496.03	7.78
8	其他各项资产	144,920.67	0.44
9	合计	32,786,539.35	100.00

注：此处股票投资项包含可退替代款估值增值，而7.2的合计项不含可退替代款估值增值，两者在金额上可能不相等。

## 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	216,390.00	0.66
B	采矿业	1,136,328.50	3.47
C	制造业	18,869,789.96	57.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	925,159.60	2.83
E	建筑业	343,887.00	1.05
F	批发和零售业	976,630.46	2.98
G	交通运输、仓储和邮政业	464,869.47	1.42
H	住宿和餐饮业	56,850.00	0.17
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,410,502.54	7.37
J	金融业	2,613,788.10	7.99
K	房地产业	419,483.00	1.28
L	租赁和商务服务业	381,675.00	1.17
M	科学研究和技术服务业	342,745.00	1.05
N	水利、环境和公共设施管理业	173,073.20	0.53
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	149,549.00	0.46
R	文化、体育和娱乐业	439,496.00	1.34
S	综合	163,207.00	0.50
	合计	30,083,423.83	91.94

### 7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极股票投资。

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	300308	中际旭创	2,900	427,605.00	1.31
2	000988	华工科技	4,600	174,846.00	0.53
3	688256	寒武纪	900	169,200.00	0.52
4	002340	格林美	23,600	163,076.00	0.50
5	002384	东山精密	6,200	160,580.00	0.49
6	002422	科伦药业	5,400	160,272.00	0.49
7	600372	中航电子	10,300	156,354.00	0.48
8	300418	昆仑万维	3,800	153,064.00	0.47
9	300012	华测检测	7,700	150,150.00	0.46
10	600079	人福医药	5,200	140,088.00	0.43
11	600489	中金黄金	13,300	137,389.00	0.42
12	300003	乐普医疗	6,000	135,660.00	0.41
13	300724	捷佳伟创	1,200	134,820.00	0.41
14	600487	亨通光电	9,000	131,940.00	0.40
15	002028	思源电气	2,799	130,769.28	0.40
16	688777	中控技术	2,075	130,268.50	0.40
17	002738	中矿资源	2,540	129,387.60	0.40
18	002463	沪电股份	6,100	127,734.00	0.39
19	601555	东吴证券	18,400	127,696.00	0.39
20	601058	赛轮轮胎	11,200	127,568.00	0.39
21	600536	中国软件	2,679	125,591.52	0.38
22	300037	新宙邦	2,400	124,536.00	0.38
23	600765	中航重机	4,680	124,066.80	0.38
24	000066	中国长城	8,900	123,087.00	0.38

25	000807	云铝股份	9,500	120,935.00	0.37
26	600885	宏发股份	3,780	120,393.00	0.37
27	600482	中国动力	4,900	114,856.00	0.35
28	000009	中国宝安	9,400	113,458.00	0.35
29	000423	东阿阿胶	2,100	112,245.00	0.34
30	600352	浙江龙盛	11,900	111,265.00	0.34
31	300146	汤臣倍健	4,600	110,308.00	0.34
32	300058	蓝色光标	11,400	110,238.00	0.34
33	002966	苏州银行	16,790	109,974.50	0.34
34	002156	通富微电	4,800	108,480.00	0.33
35	601108	财通证券	14,900	107,876.00	0.33
36	002185	华天科技	11,700	107,640.00	0.33
37	600415	小商品城	12,600	107,478.00	0.33
38	002625	光启技术	6,900	105,294.00	0.32
39	002624	完美世界	6,200	104,718.00	0.32
40	600027	华电国际	15,600	104,364.00	0.32
41	300144	宋城演艺	8,400	104,160.00	0.32
42	000783	长江证券	17,800	103,240.00	0.32
43	600109	国金证券	11,900	103,173.00	0.32
44	688099	晶晨股份	1,216	102,533.12	0.31
45	600988	赤峰黄金	7,600	102,296.00	0.31
46	601233	桐昆股份	7,700	102,025.00	0.31
47	601077	渝农商行	28,400	101,956.00	0.31
48	600418	江淮汽车	8,000	100,720.00	0.31
49	600096	云天化	5,900	100,713.00	0.31
50	600161	天坛生物	3,700	100,455.00	0.31
51	002385	大北农	15,200	100,320.00	0.31
52	300568	星源材质	5,800	99,702.00	0.30
53	002008	大族激光	3,800	99,560.00	0.30
54	300285	国瓷材料	3,600	98,640.00	0.30
55	000630	铜陵有色	33,900	97,971.00	0.30

56	600298	安琪酵母	2,700	97,767.00	0.30
57	002223	鱼跃医疗	2,700	97,173.00	0.30
58	600862	中航高科	3,800	96,178.00	0.29
59	002407	多氟多	4,840	96,122.40	0.29
60	601162	天风证券	31,900	95,062.00	0.29
61	300024	机器人	5,700	95,019.00	0.29
62	002409	雅克科技	1,300	94,744.00	0.29
63	300390	天华新能	2,640	94,512.00	0.29
64	002497	雅化集团	5,300	94,234.00	0.29
65	000933	神火股份	7,200	93,600.00	0.29
66	600705	中航产融	24,300	93,069.00	0.28
67	002240	盛新锂能	2,900	92,423.00	0.28
68	601168	西部矿业	8,700	91,437.00	0.28
69	603688	石英股份	800	91,072.00	0.28
70	000932	华菱钢铁	19,000	90,630.00	0.28
71	603882	金域医学	1,200	90,600.00	0.28
72	300073	当升科技	1,800	90,594.00	0.28
73	300604	长川科技	1,900	90,231.00	0.28
74	300474	景嘉微	1,000	89,990.00	0.28
75	600066	宇通客车	6,100	89,914.00	0.27
76	002439	启明星辰	3,000	89,280.00	0.27
77	002600	领益智造	12,900	89,139.00	0.27
78	600060	海信视像	3,600	89,100.00	0.27
79	000975	银泰黄金	7,600	88,920.00	0.27
80	300395	菲利华	1,800	88,560.00	0.27
81	002138	顺络电子	3,700	88,467.00	0.27
82	300136	信维通信	4,400	88,352.00	0.27
83	605358	立昂微	2,400	88,152.00	0.27
84	002797	第一创业	15,400	88,088.00	0.27
85	002568	百润股份	2,400	87,240.00	0.27
86	603596	伯特利	1,100	87,186.00	0.27

87	002465	海格通信	8,400	86,856.00	0.27
88	000021	深科技	4,300	85,957.00	0.26
89	601128	常熟银行	12,600	85,932.00	0.26
90	300253	卫宁健康	7,900	85,478.00	0.26
91	600160	巨化股份	6,200	85,436.00	0.26
92	600839	四川长虹	16,900	85,345.00	0.26
93	600879	航天电子	10,000	84,900.00	0.26
94	000591	太阳能	12,500	84,750.00	0.26
95	603939	益丰药房	2,280	84,360.00	0.26
96	600873	梅花生物	9,400	83,942.00	0.26
97	603816	顾家家居	2,200	83,930.00	0.26
98	000683	远兴能源	11,600	83,404.00	0.25
99	601990	南京证券	10,100	82,618.00	0.25
100	300832	新产业	1,400	82,600.00	0.25
101	600563	法拉电子	600	82,380.00	0.25
102	600392	盛和资源	6,400	82,368.00	0.25
103	600497	驰宏锌锗	16,400	82,328.00	0.25
104	002078	太阳纸业	7,700	82,313.00	0.25
105	688567	孚能科技	3,800	82,042.00	0.25
106	300699	光威复材	2,640	81,444.00	0.25
107	601696	中银证券	7,600	81,016.00	0.25
108	600177	雅戈尔	12,700	80,137.00	0.24
109	600516	方大炭素	12,900	79,980.00	0.24
110	000831	中国稀土	2,700	79,920.00	0.24
111	000729	燕京啤酒	6,400	79,808.00	0.24
112	300017	网宿科技	11,200	79,632.00	0.24
113	300118	东方日升	3,100	79,453.00	0.24
114	002850	科达利	600	79,350.00	0.24
115	688521	芯原股份	1,100	79,112.00	0.24
116	002368	太极股份	1,920	79,046.40	0.24
117	603589	口子窖	1,600	78,960.00	0.24



118	300866	安克创新	900	78,750.00	0.24
119	600642	申能股份	11,200	78,288.00	0.24
120	000728	国元证券	12,000	78,240.00	0.24
121	002673	西部证券	12,300	78,105.00	0.24
122	002294	信立泰	2,500	77,975.00	0.24
123	600141	兴发集团	3,500	77,770.00	0.24
124	600699	均胜电子	4,400	77,616.00	0.24
125	000629	钒钛股份	19,700	77,027.00	0.24
126	600170	上海建工	28,600	76,934.00	0.24
127	002532	天山铝业	12,800	76,672.00	0.23
128	002025	航天电器	1,200	76,560.00	0.23
129	600118	中国卫星	2,700	76,167.00	0.23
130	002195	岩山科技	26,300	76,007.00	0.23
131	600325	华发股份	7,700	75,845.00	0.23
132	002430	杭氧股份	2,200	75,592.00	0.23
133	600153	建发股份	6,900	75,279.00	0.23
134	002268	电科网安	2,700	75,249.00	0.23
135	002739	万达电影	6,000	75,240.00	0.23
136	002273	水晶光电	6,300	75,222.00	0.23
137	600166	福田汽车	22,000	74,800.00	0.23
138	600549	厦门钨业	3,900	74,217.00	0.23
139	600143	金发科技	8,500	74,205.00	0.23
140	002372	伟星新材	3,600	73,944.00	0.23
141	000400	许继电气	3,200	73,760.00	0.23
142	000998	隆平高科	4,800	73,680.00	0.23
143	600521	华海药业	4,000	73,640.00	0.23
144	600637	东方明珠	9,400	73,508.00	0.22
145	600399	抚顺特钢	7,200	73,440.00	0.22
146	601966	玲珑轮胎	3,300	73,326.00	0.22
147	603000	人民网	2,500	73,000.00	0.22
148	002065	东华软件	10,300	72,718.00	0.22

149	300595	欧普康视	2,400	72,456.00	0.22
150	002444	巨星科技	3,300	72,204.00	0.22
151	000738	航发控制	2,942	71,784.80	0.22
152	300487	蓝晓科技	1,150	71,783.00	0.22
153	601577	长沙银行	9,200	71,392.00	0.22
154	601198	东兴证券	8,900	71,378.00	0.22
155	002131	利欧股份	31,000	71,300.00	0.22
156	600481	双良节能	5,100	71,298.00	0.22
157	600859	王府井	3,600	71,244.00	0.22
158	300383	光环新网	6,600	70,950.00	0.22
159	600704	物产中大	14,300	70,642.00	0.22
160	600499	科达制造	6,200	70,432.00	0.22
161	002353	杰瑞股份	2,800	70,364.00	0.22
162	688390	固德威	420	70,081.20	0.21
163	000960	锡业股份	4,500	69,975.00	0.21
164	600486	扬农化工	800	69,936.00	0.21
165	000997	新大陆	3,700	69,930.00	0.21
166	300682	朗新科技	3,000	69,840.00	0.21
167	600271	航天信息	5,100	69,819.00	0.21
168	688002	睿创微纳	1,558	69,798.40	0.21
169	601997	贵阳银行	13,400	69,144.00	0.21
170	603077	和邦生物	28,400	69,012.00	0.21
171	600021	上海电力	6,400	68,928.00	0.21
172	000519	中兵红箭	3,800	68,742.00	0.21
173	300001	特锐德	3,300	68,574.00	0.21
174	000703	恒逸石化	10,100	68,478.00	0.21
175	688009	中国通号	11,800	68,440.00	0.21
176	002373	千方科技	5,000	68,200.00	0.21
177	688220	翱捷科技	900	67,851.00	0.21
178	300088	长信科技	11,200	67,536.00	0.21
179	002056	横店东磁	3,700	67,377.00	0.21

180	000623	吉林敖东	4,200	67,368.00	0.21
181	600380	健康元	5,300	67,363.00	0.21
182	300438	鹏辉能源	1,400	67,256.00	0.21
183	600867	通化东宝	6,400	66,816.00	0.20
184	002152	广电运通	5,700	66,804.00	0.20
185	002281	光迅科技	1,800	66,762.00	0.20
186	002507	涪陵榨菜	3,640	66,648.40	0.20
187	600998	九州通	6,407	66,504.66	0.20
188	000513	丽珠集团	1,700	66,147.00	0.20
189	600511	国药股份	1,700	66,045.00	0.20
190	300676	华大基因	1,100	65,989.00	0.20
191	688536	思瑞浦	300	65,400.00	0.20
192	601016	节能风电	17,820	65,399.40	0.20
193	600529	山东药玻	2,400	65,328.00	0.20
194	600348	华阳股份	8,250	65,257.50	0.20
195	600498	烽火通信	3,200	65,184.00	0.20
196	600546	山煤国际	4,500	65,115.00	0.20
197	002299	圣农发展	3,400	65,110.00	0.20
198	002203	海亮股份	5,400	64,854.00	0.20
199	600739	辽宁成大	4,900	64,435.00	0.20
200	000636	风华高科	4,200	64,428.00	0.20
201	688169	石头科技	200	64,136.00	0.20
202	601636	旗滨集团	7,400	63,788.00	0.19
203	603712	七一二	2,100	63,441.00	0.19
204	002595	豪迈科技	1,800	63,234.00	0.19
205	603517	绝味食品	1,700	63,155.00	0.19
206	002506	协鑫集成	21,500	62,995.00	0.19
207	002531	天顺风能	4,100	62,443.00	0.19
208	600863	内蒙华电	15,000	62,250.00	0.19
209	603885	吉祥航空	4,000	61,720.00	0.19
210	603338	浙江鼎力	1,100	61,611.00	0.19

211	002080	中材科技	3,000	61,560.00	0.19
212	603737	三棵树	940	61,494.80	0.19
213	600580	卧龙电驱	4,200	61,362.00	0.19
214	002092	中泰化学	9,500	61,275.00	0.19
215	300182	捷成股份	9,700	61,207.00	0.19
216	600970	中材国际	4,800	61,200.00	0.19
217	600655	豫园股份	8,900	61,054.00	0.19
218	000878	云南铜业	5,500	60,775.00	0.19
219	300296	利亚德	9,300	60,729.00	0.19
220	600820	隧道股份	10,100	60,701.00	0.19
221	300212	易华录	1,820	60,478.60	0.18
222	688772	珠海冠宇	3,000	60,450.00	0.18
223	600528	中铁工业	6,100	60,268.00	0.18
224	600909	华安证券	12,900	60,243.00	0.18
225	002939	长城证券	7,400	60,162.00	0.18
226	002192	融捷股份	900	60,147.00	0.18
227	002432	九安医疗	1,700	59,857.00	0.18
228	002926	华西证券	7,200	59,832.00	0.18
229	600535	天士力	4,100	59,491.00	0.18
230	603927	中科软	1,540	59,382.40	0.18
231	300244	迪安诊断	2,300	58,949.00	0.18
232	002683	广东宏大	2,000	58,880.00	0.18
233	000750	国海证券	17,500	58,625.00	0.18
234	600329	达仁堂	1,300	58,357.00	0.18
235	600008	首创环保	20,210	58,204.80	0.18
236	000547	航天发展	5,800	58,000.00	0.18
237	000039	中集集团	8,400	57,876.00	0.18
238	603233	大参林	2,060	57,700.60	0.18
239	000893	亚钾国际	2,500	57,350.00	0.18
240	600416	湘电股份	3,000	57,270.00	0.18
241	002429	兆驰股份	10,400	57,200.00	0.17

242	000970	中科三环	4,450	57,049.00	0.17
243	000060	中金岭南	12,000	57,000.00	0.17
244	600258	首旅酒店	3,000	56,850.00	0.17
245	300748	金力永磁	1,900	56,848.00	0.17
246	603156	养元饮品	2,300	56,810.00	0.17
247	601991	大唐发电	17,100	56,601.00	0.17
248	688516	奥特维	300	56,520.00	0.17
249	688301	奕瑞科技	200	56,486.00	0.17
250	000830	鲁西化工	5,300	55,968.00	0.17
251	603160	汇顶科技	1,200	55,500.00	0.17
252	600369	西南证券	15,200	55,480.00	0.17
253	600390	五矿资本	10,300	55,414.00	0.17
254	002500	山西证券	9,900	55,242.00	0.17
255	600435	北方导航	4,800	55,152.00	0.17
256	688385	复旦微电	1,100	55,110.00	0.17
257	603456	九洲药业	2,000	54,760.00	0.17
258	002936	郑州银行	23,641	54,374.30	0.17
259	600398	海澜之家	7,900	54,352.00	0.17
260	002128	电投能源	4,100	54,202.00	0.17
261	002557	洽洽食品	1,300	54,015.00	0.17
262	601880	辽港股份	34,600	53,976.00	0.16
263	300070	碧水源	10,000	53,600.00	0.16
264	002508	老板电器	2,100	53,109.00	0.16
265	300009	安科生物	5,304	53,040.00	0.16
266	300558	贝达药业	1,100	52,833.00	0.16
267	600848	上海临港	4,400	52,580.00	0.16
268	002153	石基信息	3,744	52,416.00	0.16
269	601717	郑煤机	4,200	52,290.00	0.16
270	300026	红日药业	9,600	52,032.00	0.16
271	600985	淮北矿业	4,500	51,840.00	0.16
272	600038	中直股份	1,300	51,766.00	0.16

273	603658	安图生物	1,000	51,730.00	0.16
274	603858	步长制药	2,500	51,475.00	0.16
275	000050	深天马 A	5,600	51,408.00	0.16
276	300529	健帆生物	2,200	50,996.00	0.16
277	603893	瑞芯微	700	50,995.00	0.16
278	601179	中国西电	9,400	50,854.00	0.16
279	603127	昭衍新药	1,240	50,716.00	0.16
280	002572	索菲亚	2,900	50,518.00	0.15
281	002244	滨江集团	5,700	50,274.00	0.15
282	600673	东阳光	6,900	49,749.00	0.15
283	002266	浙富控股	12,000	49,560.00	0.15
284	002408	齐翔腾达	7,760	49,431.20	0.15
285	003035	南网能源	6,900	49,128.00	0.15
286	603444	吉比特	100	49,111.00	0.15
287	601958	金钼股份	4,400	49,060.00	0.15
288	600895	张江高科	3,500	48,720.00	0.15
289	300373	扬杰科技	1,200	48,684.00	0.15
290	600667	太极实业	6,700	48,642.00	0.15
291	688538	和辉光电	19,100	48,514.00	0.15
292	688779	长远锂科	4,300	48,461.00	0.15
293	002958	青农商行	17,800	48,416.00	0.15
294	600208	新湖中宝	19,500	48,360.00	0.15
295	002019	亿帆医药	3,300	48,180.00	0.15
296	600827	百联股份	3,600	48,132.00	0.15
297	601000	唐山港	13,600	48,008.00	0.15
298	000739	普洛药业	2,700	47,898.00	0.15
299	000155	川能动力	3,300	47,520.00	0.15
300	600282	南钢股份	14,100	47,517.00	0.15
301	601666	平煤股份	6,300	47,502.00	0.15
302	600171	上海贝岭	2,600	47,450.00	0.15
303	600755	厦门国贸	6,100	47,214.00	0.14

304	000887	中鼎股份	3,600	47,124.00	0.14
305	300357	我武生物	1,400	47,082.00	0.14
306	600959	江苏有线	13,800	46,644.00	0.14
307	002670	国盛金控	5,300	46,534.00	0.14
308	600566	济川药业	1,600	46,464.00	0.14
309	002155	湖南黄金	3,800	46,360.00	0.14
310	300677	英科医疗	2,100	46,200.00	0.14
311	688200	华峰测控	300	45,900.00	0.14
312	688116	天奈科技	1,000	45,750.00	0.14
313	300115	长盈精密	3,840	45,734.40	0.14
314	603267	鸿远电子	700	45,710.00	0.14
315	600378	昊华科技	1,200	45,168.00	0.14
316	601866	中远海发	18,201	44,956.47	0.14
317	601231	环旭电子	3,000	44,880.00	0.14
317	000778	新兴铸管	11,000	44,880.00	0.14
319	600316	洪都航空	1,900	44,555.00	0.14
320	000598	兴蓉环境	8,200	44,526.00	0.14
321	600517	国网英大	7,800	44,460.00	0.14
322	002030	达安基因	4,456	44,426.32	0.14
323	600131	国网信通	2,200	44,418.00	0.14
324	300363	博腾股份	1,500	44,385.00	0.14
325	600582	天地科技	7,600	44,308.00	0.14
326	600056	中国医药	3,400	44,132.00	0.13
327	603218	日月股份	2,300	43,677.00	0.13
328	000987	越秀资本	6,870	43,624.50	0.13
329	600315	上海家化	1,500	43,515.00	0.13
330	300888	稳健医疗	1,040	43,336.80	0.13
331	002249	大洋电机	7,600	43,320.00	0.13
332	002221	东华能源	5,000	43,250.00	0.13
333	000027	深圳能源	6,560	43,230.40	0.13
334	002487	大金重工	1,400	43,176.00	0.13

335	000709	河钢股份	19,000	42,940.00	0.13
336	300251	光线传媒	5,300	42,877.00	0.13
337	002326	永太科技	2,800	42,812.00	0.13
338	600598	北大荒	3,200	42,656.00	0.13
339	600906	财达证券	5,900	42,480.00	0.13
340	601106	中国一重	12,600	42,336.00	0.13
341	002183	怡亚通	8,300	42,330.00	0.13
342	601992	金隅集团	19,100	41,638.00	0.13
343	600718	东软集团	3,900	41,574.00	0.13
344	603026	胜华新材	700	41,475.00	0.13
345	002831	裕同科技	1,700	41,463.00	0.13
346	002690	美亚光电	1,606	41,354.50	0.13
347	600373	中文传媒	3,100	41,292.00	0.13
348	601665	齐鲁银行	10,500	41,160.00	0.13
349	000883	湖北能源	9,000	41,040.00	0.13
350	000825	太钢不锈	10,500	40,635.00	0.12
351	603568	伟明环保	2,320	40,623.20	0.12
352	601778	晶科科技	8,200	40,508.00	0.12
353	002511	中顺洁柔	3,600	40,140.00	0.12
354	002518	科士达	1,000	40,010.00	0.12
355	601928	凤凰传媒	3,500	39,900.00	0.12
356	002985	北摩高科	902	39,796.24	0.12
357	603883	老百姓	1,332	39,760.20	0.12
358	603228	景旺电子	1,540	39,501.00	0.12
359	600663	陆家嘴	4,000	39,480.00	0.12
360	600737	中粮糖业	4,900	39,445.00	0.12
361	600967	内蒙一机	3,900	39,390.00	0.12
362	600297	广汇汽车	18,600	38,688.00	0.12
363	603225	新凤鸣	3,500	38,675.00	0.12
364	600155	华创云信	6,200	38,564.00	0.12
365	600801	华新水泥	3,100	38,285.00	0.12



366	601098	中南传媒	3,300	38,280.00	0.12
367	002468	申通快递	3,500	37,870.00	0.12
368	688188	柏楚电子	200	37,712.00	0.12
369	300776	帝尔激光	580	37,642.00	0.12
370	000012	南玻 A	6,300	37,548.00	0.11
371	001227	兰州银行	13,100	37,466.00	0.11
372	600871	石化油服	18,700	37,026.00	0.11
373	002745	木林森	4,000	36,800.00	0.11
374	600500	中化国际	6,600	36,696.00	0.11
375	000156	华数传媒	4,200	36,540.00	0.11
376	300482	万孚生物	1,370	36,483.10	0.11
377	688208	道通科技	1,200	36,372.00	0.11
378	603866	桃李面包	3,590	36,330.80	0.11
379	000581	威孚高科	2,300	36,225.00	0.11
380	603529	爱玛科技	1,100	35,442.00	0.11
381	000401	冀东水泥	4,800	35,376.00	0.11
382	002032	苏泊尔	700	35,000.00	0.11
383	688690	纳微科技	900	34,965.00	0.11
384	601118	海南橡胶	7,800	34,944.00	0.11
385	301029	怡合达	780	34,850.40	0.11
386	600556	天下秀	4,900	34,741.00	0.11
387	300861	美畅股份	800	34,696.00	0.11
388	002867	周大生	1,950	34,671.00	0.11
389	688778	厦钨新能	700	34,650.00	0.11
390	601611	中国核建	4,100	34,645.00	0.11
391	002250	联化科技	3,300	34,518.00	0.11
392	000785	居然之家	9,000	34,290.00	0.10
393	002010	传化智联	6,400	34,048.00	0.10
394	688520	神州细胞	600	34,044.00	0.10
395	000930	中粮科技	4,200	34,020.00	0.10
396	300850	新强联	900	33,642.00	0.10

397	002423	中粮资本	4,200	33,600.00	0.10
398	601598	中国外运	7,200	33,552.00	0.10
399	601608	中信重工	7,900	33,259.00	0.10
400	688082	盛美上海	300	33,120.00	0.10
401	600062	华润双鹤	1,900	33,098.00	0.10
402	002505	鹏都农牧	17,500	33,075.00	0.10
403	002081	金螳螂	7,300	32,923.00	0.10
404	000559	万向钱潮	6,000	32,700.00	0.10
405	000089	深圳机场	4,700	32,665.00	0.10
406	600782	新钢股份	8,800	32,648.00	0.10
407	600259	广晟有色	900	32,526.00	0.10
408	002791	坚朗五金	500	32,355.00	0.10
409	600597	光明乳业	3,100	32,240.00	0.10
410	000958	电投产融	7,400	32,042.00	0.10
411	600901	江苏金租	7,660	31,635.80	0.10
412	600707	彩虹股份	6,600	31,416.00	0.10
413	600339	中油工程	7,700	31,339.00	0.10
414	688276	百克生物	500	31,300.00	0.10
415	603638	艾迪精密	1,520	31,190.40	0.10
416	000937	冀中能源	4,800	30,624.00	0.09
417	000898	鞍钢股份	11,000	30,580.00	0.09
418	600409	三友化工	5,600	30,520.00	0.09
419	688006	杭可科技	1,000	30,470.00	0.09
420	600095	湘财股份	3,900	30,420.00	0.09
421	601187	厦门银行	6,000	30,120.00	0.09
422	603826	坤彩科技	600	30,000.00	0.09
423	601718	际华集团	10,100	29,997.00	0.09
424	000415	渤海租赁	14,200	29,820.00	0.09
425	600507	方大特钢	6,367	29,479.21	0.09
426	000967	盈峰环境	5,800	29,290.00	0.09
427	600167	联美控股	4,200	29,274.00	0.09

428	603707	健友股份	2,168	29,268.00	0.09
429	000537	广宇发展	2,500	29,175.00	0.09
430	300618	寒锐钴业	900	29,169.00	0.09
431	002761	浙江建投	1,900	28,842.00	0.09
432	601568	北元集团	5,440	28,668.80	0.09
433	001914	招商积余	1,900	28,595.00	0.09
434	600968	海油发展	9,300	28,551.00	0.09
435	600808	马钢股份	11,100	28,527.00	0.09
436	000563	陕国投 A	9,340	28,487.00	0.09
437	688029	南微医学	340	27,730.40	0.08
438	688107	安路科技	500	27,695.00	0.08
439	002925	盈趣科技	1,420	27,548.00	0.08
440	300257	开山股份	1,800	27,306.00	0.08
441	601156	东航物流	2,100	27,300.00	0.08
442	600195	中牧股份	2,332	27,237.76	0.08
443	002705	新宝股份	1,500	27,045.00	0.08
444	600126	杭钢股份	6,200	26,908.00	0.08
445	603650	彤程新材	800	26,240.00	0.08
446	002608	江苏国信	3,400	25,738.00	0.08
447	603379	三美股份	1,060	24,920.60	0.08
448	000402	金融街	5,500	24,860.00	0.08
449	000959	首钢股份	7,100	24,850.00	0.08
450	300442	润泽科技	800	24,608.00	0.08
451	600764	中国海防	900	24,498.00	0.07
452	688185	康希诺	300	24,450.00	0.07
453	002110	三钢闽光	5,600	23,632.00	0.07
454	002653	海思科	1,000	23,600.00	0.07
455	601828	美凯龙	4,900	23,471.00	0.07
456	002563	森马服饰	3,700	23,014.00	0.07
457	601298	青岛港	3,200	22,304.00	0.07
458	601228	广州港	6,900	22,287.00	0.07

459	001203	大中矿业	2,000	22,220.00	0.07
460	688234	天岳先进	300	22,182.00	0.07
461	688819	天能股份	600	22,104.00	0.07
462	688289	圣湘生物	1,292	21,757.28	0.07
463	600377	宁沪高速	2,200	21,626.00	0.07
464	000031	大悦城	5,900	21,594.00	0.07
465	603056	德邦股份	1,400	21,588.00	0.07
466	600928	西安银行	6,100	21,472.00	0.07
467	603317	天味食品	1,467	21,432.87	0.07
468	600623	华谊集团	3,400	21,182.00	0.06
469	600927	永安期货	1,300	21,138.00	0.06
470	600350	山东高速	3,100	19,747.00	0.06
471	603786	科博达	300	19,710.00	0.06
472	002399	海普瑞	1,700	19,499.00	0.06
473	601139	深圳燃气	2,600	18,954.00	0.06
474	601869	长飞光纤	500	18,505.00	0.06
475	601969	海南矿业	2,800	18,424.00	0.06
476	601136	首创证券	1,300	18,421.00	0.06
477	000869	张裕 A	600	18,396.00	0.06
478	600995	南网储能	1,600	17,616.00	0.05
479	001872	招商港口	1,000	17,270.00	0.05
480	000553	安道麦 A	2,000	16,880.00	0.05
481	002945	华林证券	1,200	16,416.00	0.05
482	688105	诺唯赞	500	15,245.00	0.05
483	601158	重庆水务	2,600	14,456.00	0.04
484	600299	安迪苏	1,800	14,346.00	0.04
485	603355	莱克电气	520	13,213.20	0.04
486	603868	飞科电器	200	12,618.00	0.04
487	600956	新天绿能	1,400	12,208.00	0.04
488	688248	南网科技	300	11,517.00	0.04
489	600032	浙江新能	900	11,304.00	0.03

490	688295	中复神鹰	300	11,004.00	0.03
491	300741	华宝股份	500	10,710.00	0.03
492	002901	大博医疗	200	6,216.00	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

注：本基金本报告期末未持有积极股票投资。

## 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	002463	沪电股份	137,205.00	0.40
2	000066	中国长城	126,033.00	0.37
3	600372	中航电子	118,466.38	0.35
4	000423	东阿阿胶	105,909.00	0.31
5	000933	神火股份	100,636.00	0.29
6	688301	奕瑞科技	99,154.00	0.29
7	002240	盛新锂能	97,299.00	0.28
8	002008	大族激光	94,598.00	0.28
9	603882	金域医学	87,363.00	0.26
10	002600	领益智造	84,478.00	0.25
11	300395	菲利华	78,962.00	0.23
12	688220	翱捷科技	75,635.01	0.22
13	300118	东方日升	73,163.00	0.21
14	601966	玲珑轮胎	72,851.00	0.21
15	688536	思瑞浦	72,402.00	0.21
16	300487	蓝晓科技	72,237.00	0.21
17	300595	欧普康视	69,923.00	0.20
18	002432	九安医疗	68,580.00	0.20
19	688169	石头科技	66,860.00	0.20
20	300438	鹏辉能源	63,729.00	0.19

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超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	600157	永泰能源	166,212.00	0.49
2	603345	安井食品	154,684.00	0.45
3	601607	上海医药	122,900.00	0.36
4	000999	华润三九	119,545.00	0.35
5	688122	西部超导	117,504.60	0.34
6	002603	以岭药业	113,534.80	0.33
7	603613	国联股份	107,699.40	0.32
8	601699	潞安环能	100,821.00	0.30
9	300168	万达信息	99,449.00	0.29
10	601872	招商轮船	97,943.00	0.29
11	603605	珀莱雅	95,496.68	0.28
12	603606	东方电缆	86,754.00	0.25
13	600026	中远海能	85,494.78	0.25
14	300418	昆仑万维	79,538.00	0.23
15	688063	派能科技	77,364.00	0.23
16	002212	天融信	69,764.00	0.20
17	601333	广深铁路	68,406.00	0.20
18	002396	星网锐捷	61,459.00	0.18
19	601456	国联证券	57,718.00	0.17
20	600201	生物股份	55,099.00	0.16

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	6,234,671.86
--------------	--------------

卖出股票收入（成交）总额	7,827,738.83
--------------	--------------

注：“买入股票成本总额”和“卖出股票收入总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	8,698.82	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	8,698.82	0.03

### 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	118030	睿创转债	60	8,698.82	0.03

### 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

本基金为指数型基金,主要投资标的为指数成份股和备选成份股。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金投资于标的指数为基础资产的股指期货,目的在于满足基金日常投资管理需要,更有效地进行流动性管理,实现跟踪标的指数的投资目标。

本基金投资于股指期货,对基金总体风险的影响很小,并符合既定的投资政策和投资目标。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

**7.12.1 报告期内基金投资的前十名证券除人福医药(600079)外其他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。上海证券交易所2023年02月07日发布对人福医药集团股份公司的处罚(上海证券交易所纪律处分决定书[2023]10号)。前述发行主体受到的处罚未影响其正常业务运作,上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的规定。**

**7.12.2 基金投资的前十名股票未超过基金合同规定的备选股票库。**

### 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	144,920.67
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	-
8	其他	-
9	合计	144,920.67



**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**

注：本基金本报告期末未持有积极股票投资。

**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，各比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

**§8 基金份额持有人信息****8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数 (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		中融中证500交 易型开放式指 数证券投资基 金联接基金	
		持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总 份额 比例
334	75,885.33	2,000.00	0.01%	3,517,000.0 0	13.8 8%	21,826,70 0.00	86. 1 2%

**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	王道顺	500,000.00	1.97%
2	陈建仁	361,370.00	1.43%
3	李园园	333,400.00	1.32%
4	钱中明	189,500.00	0.75%
5	杨淑军	100,200.00	0.40%
6	陈建慧	100,000.00	0.39%
7	周京	95,000.00	0.37%
8	莫春风	93,300.00	0.37%
9	张瑞娟	90,200.00	0.36%
10	华乔	74,000.00	0.29%
-	中国光大银行股份有限公司—中融中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金	21,826,700.00	86.12%

注：1.本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人；

2.前十名持有人为除中融中证500ETF联接基金之外的前十名持有人。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本报告期末，本基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金；

2、本基金基金经理未持有本开放式基金。

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2019年11月15日)基金份额总额	235,345,700.00
本报告期期初基金份额总额	27,345,700.00
本报告期基金总申购份额	-
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	-
本报告期期末基金份额总额	25,345,700.00

注：申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

## §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，本基金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

#### (1) 基金管理人的重大人事变动情况

本基金管理人于2023年1月11日发布公告，国联基金管理有限公司副总裁卢强先生离任。

公司其他高管人员未变动。

#### (2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的会计师事务所为上会会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内未变更为其提供审计服务的会计师事务所。

### 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

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内管理人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无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	交	股票交易	应支付该券商的佣金	备

名称	易单元数量	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	注
渤海证券	2	5,936,923.72	42.54%	4,342.18	42.54%	-
广发证券	2	8,019,260.54	57.46%	5,864.17	57.46%	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

iv 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

### 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		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
渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	57,415.50	100.00%	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-

## 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	中融基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-01-11
2	中融基金管理有限公司关于中融基金直销电子交易平台等业务临时暂停服务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-02-09
3	中融基金管理有限公司关于中融基金直销电子交易平台等业务临时暂停服务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-04-22
4	中融基金管理有限公司关于公司董事变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-05-06
5	中融基金管理有限公司关于公司股东及实际控制人变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-05-06
6	中融基金管理有限公司关于中融基金直销电子交易平台等业务临时暂停服务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-06-08

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
中融中证500交易型开放式指	1	20230101-20230630	22,796,700.00	40,100.00	1,010,100.00	21,826,700.00	86.12%

数 证 券 投 资 基 金 联 接 基 金							
产品特有风险							
<p>本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，该类投资者大额赎回所持有的基金份额时，将可能产生流动性风险，即基金资产不能迅速变现，或者未能以合理的价格变现基金资产以支付投资者赎回款，对资产净值产生不利影响。</p> <p>当开放式基金发生巨额赎回，基金管理人认为基金组合资产变现能力有限或认为因应对赎回导致的资产变现对基金单位份额净值产生较大的波动时，为了切实保护存量基金份额持有人的合法权益，可能出现延期支付赎回款等情形。同时为了公平对待所有投资者合法权益不受损害，管理人有权根据基金合同和招募说明书的约定，暂停或者拒绝申购、暂停赎回，基金份额持有人存在可能无法及时赎回持有的全部基金份额的风险。</p>							

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

2023年5月6日，本基金管理人发布《中融基金管理有限公司关于公司股东及实际控制人变更的公告》，本基金管理人的股东变更为国联证券股份有限公司和上海融晟投资有限公司，实际控制人变更为无锡市国联发展（集团）有限公司。

2023年8月3日，本基金管理人发布《关于公司法定名称、住所变更的公告》，本基金管理人名称由“中融基金管理有限公司”变更为“国联基金管理有限公司”。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予中融中证500交易型开放式指数证券投资基金注册的批复文件
- (2) 《中融中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- (3) 《中融中证500交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- (4) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (5) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (6) 中国证监会要求的其他文件

### 12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可在支付工本费后，在合理时间取得上述文件的复印件。

咨询电话：国联基金管理有限公司客户服务电话400-160-6000, (010) 56517299。

网址：<http://www.glfund.com>

国联基金管理有限公司  
二〇二三年八月三十日