融通中证A500交易型开放式指数证券投资基金
2026年中期报告

2026年6月30日

基金管理人：融通基金管理有限公司

基金托管人：上海银行股份有限公司

送出日期：2026年8月28日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人上海银行股份有限公司根据融通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同约定，于 2026 年 8 月 13 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 6
3.3 其他指标 7
§4 管理人报告 7
4.1 基金管理人及基金经理情况 7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 8
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 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
§5 托管人报告 11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 11
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 11
6.1 资产负债表 11
6.2 利润表 13
6.3 净资产变动表 14
6.4 报表附注 15
§7 投资组合报告 35
7.1 期末基金资产组合情况 35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 36
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 37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 51
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 51
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 51

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 52
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 52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 52
7.12 投资组合报告附注 52

§8 基金份额持有人信息 53

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 53
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 54

§9 开放式基金份额变动 54

§10 重大事件揭示 54

10.1 基金份额持有人大会决议 54
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 54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 54
10.4 基金投资策略的改变 54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 54
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 54
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 55
10.8 其他重大事件 56

§11 影响投资者决策的其他重要信息 56

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 56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 57

§12 备查文件目录 57

12.1 备查文件目录 57
12.2 存放地点 57
12.3 查阅方式 57

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	融通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	融通中证 A500ETF
场内简称	A500ETF 融通
基金主代码	159379
交易代码	159379
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 1 月 9 日
基金管理人	融通基金管理有限公司
基金托管人	上海银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	155,821,471.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2025 年 1 月 23 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金，主要采用完全复制法，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。本基金投资策略主要包含股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、存托凭证投资策略、股指期货交易策略、国债期货交易策略、股票期权投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略等部分。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制策略，紧密跟踪中证 A500 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

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		融通基金管理有限公司	上海银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	方毅祖	周直毅
	联系电话	（0755）26948666	（021）68475608
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	custody@bosc.cn
客户服务电话		400-883-8088、（0755）26948088	95594
传真		（0755）26935005	（021）68476901
注册地址		深圳市南山区粤海街道海珠社区海德三道 1066 号深创投广场 41 层、42 层	上海市黄浦区中山南路 688 号
办公地址		深圳市南山区粤海街道海珠社区海德三道 1066 号深创投广场 41 层、42 层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 号 37 层
邮政编码		518054	200120
法定代表人		张威	顾建忠

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.rtfund.com
基金中期报告置备地点	基金管理人处、基金托管人处

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026年1月1日-2026年6月30日)
本期已实现收益	32,130,921.39
本期利润	27,161,598.27
加权平均基金份额本期利润	0.1556
本期加权平均净值利润率	11.46%
本期基金份额净值增长率	14.53%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026年6月30日)
期末可供分配利润	69,776,551.96
期末可供分配基金份额利润	0.4478
期末基金资产净值	230,758,156.98
期末基金份额净值	1.4809
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026年6月30日)
基金份额累计净值增长率	48.09%

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.期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润÷期末基金份额总额。其中期末可供分配利润：如果期末未分配利润的未实现部分为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分,如果期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	16.42%	1.39%	14.26%	1.41%	2.16%	-0.02%
过去六个月	14.53%	1.28%	11.91%	1.29%	2.62%	-0.01%

过去一年	41.71%	1.13%	36.38%	1.14%	5.33%	-0.01%
自基金合同生效起至今	48.09%	1.10%	42.61%	1.12%	5.48%	-0.02%

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



注：本基金的建仓期为自合同生效日起 6 个月，至建仓期结束，各项资产配置比例符合合同约定。

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

融通基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经中国证监会证监基字[2001]8 号文批准，于 2001 年 5 月 22 日成立，公司注册资本 12500 万元人民币。本公司的股东及其出资比例为：诚通证券股份有限公司 60%、奥明资产管理有限公司（Amova Asset Management Co.,Ltd.）40%。本基金管理人拥有公募基金管理资格、特定客户（专户）资产管理资格、合格境内机构投资者资格（QDII）、保险资产受托管理资格、人民币合格境内机构投资者（RQDII）资格、合格境内投资企业（QDIE）资格，产品线完备，涵盖主动权益类基金、被动投资类基金、债券基金、货币基金、混合基金、QDII 基金等。

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		
熊俊杰	本基金的基金经理	2025 年 1 月 9 日	-	8 年	熊俊杰先生，理学硕士，8 年证券基金行业从业经历，具有基金从业资格。2017 年 10 月至 2018 年 11 月在招商期货有限公司资产管理部工作,2018 年 12 月至 2023 年 7 月在新华基金管理股份有限公司先后担任研究员、投资经理、基金经理助理,2023 年 7 月加入融通基金管理有限公司。现任融通巨潮 100 指数证券投资基金(LOF)基金经理、融通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、融通中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理、融通深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、融通中证诚通央企红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、融通上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金经理。

注：任免日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写；证券从业年限以从事证券、基金业务相关工作的时间为计算标准。

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

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规和本基金合同的规定，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，为基金持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为，本基金投资组合符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

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

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合的原则，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。

本基金管理人对报告期内不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内、10 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行了分析，各投资组合的同向交易价差均处于合理范围之内。

报告期内，本基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发生异常交易。

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

在严格遵守基金合同的前提下实现持有人利益的最大化是本基金管理的核心思想，并将此原则贯彻于基金的运作之中。本基金运用指数化投资方式，主要采用完全复制法，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

基金操作层面，2026 年 6 月中证 A500 成分股调整，根据自研的成分股调整换仓指令生产系统成功进行换仓操作，保证基金在成分股调整期间平稳运行。回顾 2026 年上半年，中证 A500 上涨 11.91%，沪深 300 上涨 7.55%，中证 500 上涨 20.97%，中证 1000 上涨 15.99%，创业板指上涨 35.58%，总体呈现中大盘成长占优的行情，大盘价值板块表现相对稳健。市场日均成交额约 2.7 万亿，相较 2025 年下半年明显放量；两融余额显著攀升，其占流通市值的比例亦同步提升；近 60 个交易日新成立偏股基金份额约 2300 亿，较前期略有回落。总体而言，市场情绪持续走高。

估值方面，各类风格估值短期内依旧处在偏高位置，中长期看也处于合理偏高水平。短期来看，大中盘成长的高估程度较为严重，而价值板块（尤其是大盘价值）处在偏低估位置；长期来看，中小盘成长高估程度较为严重，大盘价值处在相对低估位置。资金方面，杠杆资金入市情绪持续火热，但需警惕杠杆资金情绪过高导致的市场波动加剧风险。风格方面，2026 年二季度，市场风格明显切向动量成长。具体看，成长表现较好，小市值、低 beta、低估值、低波动和低流动性表现相对较弱；从风格拥挤度和离散度看，成长和杠杆风格拥挤度相对较高，存在一定的风险，流动性的离散度相对较低，其他风格离散度处在相对合理水平。

总体而言，从情绪看，市场情绪持续火热，短期市场存在降温的可能性；从估值维度看，当下估值长期也到了合理偏高估水平，后续可能需要业绩持续验证来推动行情持续向上；从资金维度看，需要警惕杠杆资金情绪过高导致的市场波动加剧风险；从风格看，成长和杠杆风格相对拥挤，需要注意未来成长风格回调的风险。

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 1.4809 元；本报告期基金份额净值增长率为 14.53%，业绩比较基准收益率为 11.91%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾 2026 年上半年，国内宏观经济在“十五五”规划开局及各项稳增长政策的协同发力下，延续了温和复苏的态势。内需潜力在政策引导下逐步释放，新质生产力相关领域表现活跃，经济结构持续优化。A 股市场在经历 2025 年底的蓄势盘整后，总体呈现震荡分化格局，以人工智能、半导体、高端制造为代表的科技成长板块在产业政策催化下成为核心主线。然而，外部环境在上

半年发生了预期之外的剧烈反转。年初，市场普遍预期美联储将延续降息周期，但在 AI 资本开支过热、中东地缘冲突推升油价等多重因素交织下，美国通胀黏性超预期，核心 PCE 物价指数持续反弹。6 月美联储议息会议虽维持利率不变，但点阵图彻底删除了年内降息预期，甚至显示多名委员支持加息。这一“由鸽转鹰”的剧烈预期修正，导致美债收益率大幅飙升，美元指数走强，对全球风险偏好及新兴市场流动性形成了阶段性压制。

展望 2026 年下半年，内部来看，适度宽松的货币政策和积极有为的财政政策仍将保驾护航，政策空间保持灵活。“十五五”规划元年的各项产业细则有望加速落地，经济基本面有望持续企稳向好，上市公司盈利端有望迎来进一步改善，为 A 股市场提供坚实的内部支撑。外部来看，美联储的货币政策走向成为最大外部变量。当前市场或已充分定价美联储年内重启加息的预期，全球流动性环境面临收紧压力。高企的美债收益率和强势美元可能持续对全球风险偏好形成压制，外资流入新兴市场的节奏或受到一定扰动。但考虑到国内经济基本面的韧性以及货币政策“以我为主”的独立性，A 股受外部冲击的影响预计相对可控，更多表现为情绪面和资金面的阶段性波折。

从风格配置来看，第一，在海外流动性预期收紧、国内经济温和复苏的背景下，市场核心驱动力正逐渐从前期的估值修复转向盈利驱动。与经济基本面强相关、具备真实盈利兑现能力的行业龙头有望占优；同时，小微盘风格前期交易拥挤，在内外部博弈加剧下存在较高的调整风险。第二，尽管外部高利率环境对高估值成长股形成一定压制，但“十五五”规划下的科技产业升级（如 AI 应用、半导体国产替代、商业航天）具备独立的产业景气周期，那些掌握核心技术、具备全球化竞争力的中大盘科技龙头仍能享受成长溢价。总体而言，大小盘维度，中大盘或将占优；成长价值维度，或将更趋于均衡，但具备业绩支撑的硬科技成长或仍是未来的主线。

本基金跟踪的中证 A500 指数聚焦大盘核心龙头板块，成长价值较为均衡。中短期而言，在外部流动性扰动加剧、市场风格偏向盈利确定性的环境下，中证 A500 凭借其核心资产属性和较高的股息率，具备较强的抗风险能力与配置价值；长期而言，随着“十五五”规划持续发力及经济逐渐改善，中证 A500 板块与经济基本面高度相关，长期配置价值高，或将持续受益于长线价值型资金的配置需求。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格按照《融通基金管理有限公司基金估值业务原则和程序管理细则》进行，公司设立由研究相关部门、风险管理部、登记清算部、稽核审计部和法律合规部共同组成的估值委员会，通过参考行业协会估值意见、参考独立第三方估值服务机构的估值数据等一种或多种方式的有效结合，减少或避免估值偏差的发生。

估值委员会定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大

事件以及估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值政策和程序的修订须经公司总经理办公会议审批后方可实施。基金在采用新投资策略或投资新品种时，应评价现有估值政策和程序的适用性。

截至本报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签订服务协议，由其提供相关债券品种和流通受限股票的估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合法律法规和基金合同的规定。

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，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同以及托管协议的有关约定，诚实、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金的利润分配情况符合有关法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人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，认为复核内容真实、准确、完整，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：融通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			

货币资金	6.4.7.1	3,712,217.63	2,772,190.13
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	228,060,624.49	260,974,610.07
其中：股票投资		228,035,623.91	260,974,610.07
基金投资		-	-
债券投资		25,000.58	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	60,492.63	-
资产总计		231,833,334.75	263,746,800.20
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026年6月30日**	**上年度末 2025年12月31日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		24,409.95	31,712.58
应付托管费		8,136.66	10,570.88
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	1,042,631.16	168,006.52
负债合计		1,075,177.77	210,289.98
净资产：			

实收基金	6.4.7.10	155,821,471.00	203,821,471.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	74,936,685.98	59,715,039.22
净资产合计		230,758,156.98	263,536,510.22
负债和净资产总计		231,833,334.75	263,746,800.20

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.4809 元，基金份额总额 155,821,471.00 份。

6.2 利润表

会计主体：融通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 9 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		27,545,983.31	36,539,992.74
1.利息收入		2,900.78	110,224.05
其中：存款利息收入	6.4.7.13	2,900.78	110,224.05
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		32,299,905.44	24,561,855.86
其中：股票投资收益	6.4.7.14	30,761,215.44	19,053,598.46
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	0.58	4,600.54
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	1,538,689.42	5,503,656.86
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	-4,969,323.12	13,060,098.75
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	212,500.21	-1,192,185.92
减：二、营业总支出		384,385.04	716,428.71
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	177,436.03	415,803.32
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	59,145.37	138,601.10

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	147,803.64	162,024.29
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		27,161,598.27	35,823,564.03
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		27,161,598.27	35,823,564.03
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		27,161,598.27	35,823,564.03

6.3 净资产变动表

会计主体：融通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	203,821,471.00	-	59,715,039.22	263,536,510.22
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	203,821,471.00	-	59,715,039.22	263,536,510.22
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-48,000,000.00	-	15,221,646.76	-32,778,353.24
（一）、综合收益总额	-	-	27,161,598.27	27,161,598.27
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-48,000,000.00	-	-11,939,951.51	-59,939,951.51
其中：1.基金申购款	144,000,000.00	-	54,109,886.81	198,109,886.81
2.基金赎回款	-192,000,000.00	-	-66,049,838.32	-258,049,838.32
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	155,821,471.00	-	74,936,685.98	230,758,156.98

项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 9 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,067,821,471.00	-	-	1,067,821,471.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-708,000,000.00	-	16,185,631.06	-691,814,368.94
（一）、综合收益总额	-	-	35,823,564.03	35,823,564.03
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-708,000,000.00	-	-19,637,932.97	-727,637,932.97
其中：1.基金申购款	111,000,000.00	-	-3,368,744.97	107,631,255.03
2.基金赎回款	-819,000,000.00	-	-16,269,188.00	-835,269,188.00
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	359,821,471.00	-	16,185,631.06	376,007,102.06

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：

商小虎	高翔	郑刚
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

融通中证 A500 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[2024]1754 号《关于准予融通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册，由融通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集，募集期为 2024 年 12 月 23 日至 2025 年 1 月 3 日。本基金为交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,049,547,000.00 元，股票认购人民币 18,221,712.00 元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2025）验字第

70072774_H01 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《融通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2025 年 1 月 9 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,067,821,471.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 52,759.00 份基金份额。本基金的基金管理人为融通基金管理有限公司，基金托管人为上海银行股份有限公司。

经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）深证上[2025]43 号文审核同意，本基金 1,067,821,471.00 份基金份额于 2025 年 1 月 23 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通中证 A500 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（含存托凭证，下同）和备选成份股（含存托凭证，下同）。为更好地实现基金的投资目标，本基金还可投资于非成份股（包括主板、创业板及其他依法发行上市的股票、存托凭证）、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、政府支持债券、地方政府债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券及其他中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、同业存单、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。本基金的业绩比较基准为：中证 A500 指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《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、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》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《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>》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》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。

本财务报表以本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于本报告截止日的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况。

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 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

本基金的主要税项列示如下：

（1）增值税及附加

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令第826号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告2026年第10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；自2026年1月1日至2027年12月31日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照3%的规定征收率计算缴纳增值税，公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入及金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

根据财政部、税务总局公告2025年第4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自2025年8月8日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在2025年8月8日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按7%、3%和2%的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

（2）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部 国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，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，暂不征收企业所得税。

（3）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金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，暂减按 25%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。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

（4）印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（5）境外投资

本基金运作过程中如有涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	312,953.13
等于：本金	312,887.91
加：应计利息	65.22
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	3,399,264.50
等于：本金	3,399,238.67
加：应计利息	25.83
减：坏账准备	-
合计	3,712,217.63

注：其他存款期末余额为存放在证券经纪商专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		206,814,573.94	-	228,035,623.91	21,221,049.97
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	24,999.89	0.69	25,000.58	0.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	24,999.89	0.69	25,000.58	0.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		206,839,573.83	0.69	228,060,624.49	21,221,049.97

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

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

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

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026年6月30日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	60,492.63
合计	60,492.63

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-

应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	88,268.27
应退替代款	916,337.48
现金差额	30,907.21
其他	7,118.20
合计	1,042,631.16

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	203,821,471.00	203,821,471.00
本期申购	144,000,000.00	144,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-192,000,000.00	-192,000,000.00
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	155,821,471.00	155,821,471.00

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	38,365,750.65	21,349,288.57	59,715,039.22
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	38,365,750.65	21,349,288.57	59,715,039.22
本期利润	32,130,921.39	-4,969,323.12	27,161,598.27
本期基金份额交易产生的变动数	-720,120.08	-11,219,831.43	-11,939,951.51
其中：基金申购款	50,024,656.88	4,085,229.93	54,109,886.81
基金赎回款	-50,744,776.96	-15,305,061.36	-66,049,838.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	69,776,551.96	5,160,134.02	74,936,685.98

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期

	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,187.74
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	713.04
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	2,900.78

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	13,779,024.46
股票投资收益——赎回差价收入	16,982,190.98
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	30,761,215.44

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	192,037,300.44
减：卖出股票成本总额	178,070,443.38
减：交易费用	187,832.60
买卖股票差价收入	13,779,024.46

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
赎回基金份额对价总额	258,049,838.32
减：现金支付赎回款总额	129,390,047.32
减：赎回股票成本总额	111,677,600.02
减：交易费用	-
赎回差价收入	16,982,190.98

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	0.58
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	0.58

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

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

无。

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

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

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

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

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

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,538,689.42
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	1,538,689.42

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	-4,969,323.12
股票投资	-4,969,323.12
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	-4,969,323.12

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	212,500.21

合计	212,500.21

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

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	18,843.91
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	28.00
其他	69,424.36
合计	147,803.64

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
融通基金管理有限公司("融通基金")	基金管理人
上海银行股份有限公司("上海银行")	基金托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 9 日(基金合同生效日) 至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	177,436.03	415,803.32
其中：应支付销售机构的客户维护费	40,272.07	130,134.67
应支付基金管理人的净管理费	137,163.96	285,668.65

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.15%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.15%/当年天数

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 9 日（基金合同生效日） 至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	59,145.37	138,601.10

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.05%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.05%/当年天数

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月9日（基金合同生效日）至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
上海银行	312,953.13	2,187.74	586,079.33	77,974.95

注：本基金由基金托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2026年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单	期末成本总额	期末估值总额	备注

							位：股）			
001220	世盟股份	2026年1月27日	1-6个月（含）	首发流通受限	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001237	惠康科技	2026年5月15日	1-6个月（含）	首发流通受限	53.26	58.74	73	3,887.98	4,288.02	-
001248	华润新能源	2026年6月24日	1个月内（含）	首发流通受限	10.11	10.11	1,311	13,254.21	13,254.21	-
001248	华润新能源	2026年6月24日	1-6个月（含）	首发流通受限	10.11	10.11	3,062	30,956.82	30,956.82	-
001257	盛龙股份	2026年3月24日	1-6个月（含）	首发流通受限	7.82	20.74	1,230	9,618.60	25,510.20	-
001312	福恩股份	2026年4月14日	1-6个月（含）	首发流通受限	18.38	16.78	92	1,690.96	1,543.76	-
001365	天海电子	2026年5月11日	1-6个月（含）	首发流通受限	27.19	31.31	177	4,812.63	5,541.87	-
001393	维通利	2026年5月8日	1-6个月（含）	首发流通受限	30.38	38.99	124	3,767.12	4,834.76	-
301513	尚水智能	2026年4月10日	1-6个月（含）	首发流通受限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春光集团	2026年4月28日	1-6个月（含）	首发流通受限	13.30	51.56	194	2,580.20	10,002.64	-
301599	理奇智能	2026年4月22日	1-6个月（含）	首发流通受限	13.91	32.47	203	2,823.73	6,591.41	-
301666	大普微	2026年4月8日	1-6个月（含）	首发流通受限	46.08	463.33	462	21,288.96	214,058.46	-
301669	高特电子	2026年6月2日	1-6个月（含）	首发流通受限	7.08	28.40	243	1,720.44	6,901.20	-
301680	固德电材	2026年2月27日	1-6个月（含）	首发流通受限	58.00	112.16	95	5,510.00	10,655.20	-
301682	宏明电子	2026年3月18日	1-6个月（含）	首发流通受限	69.66	160.06	276	19,226.16	44,176.56	-
301683	慧谷新材	2026年3月24日	1-6个月（含）	首发流通受限	78.38	121.77	67	5,251.46	8,158.59	-
301687	新广益	2025年12月24日	1-6个月（含）	首发流通受限	21.93	77.78	173	3,793.89	13,455.94	-
301696	三瑞智能	2026年3月31日	1-6个月（含）	首发流通受限	24.68	86.80	195	4,812.60	16,926.00	-
601112	振石股份	2026年1月21日	1-6个月（含）	首发流通受限	11.18	17.59	234	2,616.12	4,116.06	-
603284	林平发展	2026年2月3日	1-6个月（含）	首发流通受限	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰克	2026年4月9日	1-6个月（含）	首发流通受限	33.49	33.93	48	1,607.52	1,628.64	-

603352	至信股份	2026年1月8日	1-6个月（含）	首发流通受限	21.88	25.52	76	1,662.88	1,939.52	-
603407	长裕集团	2026年4月29日	1-6个月（含）	首发流通受限	13.86	73.46	109	1,510.74	8,007.14	-
603435	嘉德利	2026年5月15日	1-6个月（含）	首发流通受限	15.76	46.71	79	1,245.04	3,690.09	-
603459	红板科技	2026年3月31日	1-6个月（含）	首发流通受限	17.70	84.32	210	3,717.00	17,707.20	-
688635	长进光子	2026年5月20日	1-6个月（含）	首发流通受限	40.98	308.19	59	2,417.82	18,183.21	-
688712	北芯生命	2026年1月28日	1-6个月（含）	首发流通受限	17.52	35.92	1,092	19,131.84	39,224.64	-
688781	视涯科技	2026年3月18日	6个月以上	首发流通受限	22.68	42.16	2,647	60,033.96	111,597.52	-
688785	恒运昌	2026年1月20日	1-6个月（含）	首发流通受限	92.18	463.15	65	5,991.70	30,104.75	-
688790	昂瑞微	2025年12月9日	6个月以上	首发流通受限	83.06	126.45	319	26,496.14	40,337.55	-
688795	摩尔线程	2025年11月26日	6个月以上	首发流通受限	114.28	676.94	394	45,026.32	266,714.36	-
688797	臻宝科技	2026年6月16日	1-6个月（含）	首发流通受限	44.56	468.67	42	1,871.52	19,684.14	-
688808	联讯仪器	2026年4月16日	1-6个月（含）	首发流通受限	81.88	1,584.33	51	4,175.88	80,800.83	-
688811	有研复材	2026年4月1日	1-6个月（含）	首发流通受限	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688813	泰金新能	2026年3月24日	1-6个月（含）	首发流通受限	26.28	172.09	228	5,991.84	39,236.52	-
688816	易思维	2026年2月4日	1-6个月（含）	首发流通受限	55.95	57.10	104	5,818.80	5,938.40	-
688818	电科蓝天	2026年2月3日	1-6个月（含）	首发流通受限	9.47	70.14	739	6,998.33	51,833.46	-
688820	盛合晶微	2026年4月13日	1-6个月（含）	首发流通受限	19.68	141.49	359	7,065.12	50,794.91	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
111025	圣泉转债	2026年6月26日	1个月内（含）	配债流通受限	100.00	100.00	140	13,999.94	14,000.12	-
113704	春风转债	2026年6月11日	1个月内（含）	配债流通受限	100.00	100.00	110	10,999.95	11,000.46	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增

股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	832.00	2026 年 7 月 13 日	890.99	1,239	526,507.27	1,030,848.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制策略，紧密跟踪中证 A500 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似，预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金在严格控制风险并保持基金资产流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。

本基金的基金管理人奉行内控优先和全员风险管理理念，高度重视风险管理的组织保障和制度保障，建立了完备的风险管理组织及相应的制度和流程，力争在风险最小化的前提下，确保基金份额持有人利益最大化。

本基金管理人在董事会下设立风险控制与审计委员会，履行相应风险管理和监督职责。

在公司管理层下设立合规与风险管理委员会，负责指导、协调和监督各职能部门和各业务单元开展风险管理工作；识别公司各项业务所涉及的各类重大风险，对重大风险、重大决策和重要业务流程的风险进行评估，制定重大风险的解决方案；根据公司风险管理总体策略和各职能部门

与业务单元职责分工，组织实施风险应对方案。

公司所有员工是本岗位风险管理的直接责任人，各业务部门负责人是其部门风险管理的第一责任人，基金经理是相应投资组合风险管理的第一责任人。

风险管理部对公司风险管理承担独立评估、监控、检查和报告职责，负责执行公司的风险管理战略和决策，拟定公司风险管理制度，并协同各业务部门制定风险管理流程、评估指标。

监察稽核相关部门负责监察公司各业务部门在相关法律法规、规章制度和业务流程执行方面的情况，确保既定的风险管理措施得到有效的贯彻执行。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人上海银行或具备第三方存管资格的银行保管，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。

于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.01%（2025 年 12 月 31 日：本基金无债券投资）。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《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，除在本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中列示的部分基金资产流通暂时受限制外，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。除本报告“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”章节中列示的卖出回购金融资产款余额将在 1 个月内到期且计息外（如有），本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约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约到期现金流量。

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 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,712,217.63	-	-	-	3,712,217.63
交易性金融资产	-	-	25,000.58	228,035,623.91	228,060,624.49
其他资产	-	-	-	60,492.63	60,492.63
资产总计	3,712,217.63	-	25,000.58	228,096,116.54	231,833,334.75
负债					

应付管理人报酬	-	-	-	24,409.95	24,409.95
应付托管费	-	-	-	8,136.66	8,136.66
其他负债	-	-	-	1,042,631.16	1,042,631.16
负债总计	-	-	-	1,075,177.77	1,075,177.77
利率敏感度缺口	3,712,217.63	-	25,000.58	227,020,938.77	230,758,156.98
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,772,190.13	-	-	-	2,772,190.13
交易性金融资产	-	-	-	260,974,610.07	260,974,610.07
资产总计	2,772,190.13	-	-	260,974,610.07	263,746,800.20
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	31,712.58	31,712.58
应付托管费	-	-	-	10,570.88	10,570.88
其他负债	-	-	-	168,006.52	168,006.52
负债总计	-	-	-	210,289.98	210,289.98
利率敏感度缺口	2,772,190.13	-	-	260,764,320.09	263,536,510.22

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为 0.01%（2025 年 12 月 31 日：本基金未持有交易性债券投资),因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（2025 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

无。

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的股票，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。

本基金采用完全复制标的指数的方法，按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整，通过控制股票投资组合与标的指数的跟踪误差，力求实现对标的指数的有效跟踪。风险管理部负责对基金组合的跟踪误差和风险进行评估，定期提交组合跟踪误差和风险监控报告。在跟踪误差超过一定范围时，通知基金经理和相关部门，及时进行投资组合的调整。投资决策委员会根据市场变化对投资组合计划提出风险防范措施。监察稽核部对投资的决策和执行过程进行日常监督。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	228,035,623.91	98.82	260,974,610.07	99.03
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	228,035,623.91	98.82	260,974,610.07	99.03

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 A500 指数收益率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 （2026 年 6 月 30 日）	上年度末 （2025 年 12 月 31 日 ）
	1.中证 A500 指数收益率上升 5%	11,439,075.63	12,525,683.29
	2.中证 A500 指数收益率下降 5%	-11,439,075.63	-12,525,683.29

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	225,766,036.95	259,001,325.51
第二层次	1,100,059.61	1,546,502.88
第三层次	1,194,527.93	426,781.68
合计	228,060,624.49	260,974,610.07

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、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

本基金本报告期末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

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	228,035,623.91	98.36

	其中：股票	228,035,623.91	98.36
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	25,000.58	0.01
	其中：债券	25,000.58	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	3,712,217.63	1.60
8	其他各项资产	60,492.63	0.03
9	合计	231,833,334.75	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，7.2的合计项不含可退替代款估值增值。

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	714,633.00	0.31
B	采矿业	9,344,618.28	4.05
C	制造业	160,208,581.48	69.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,948,318.00	2.14
E	建筑业	2,764,172.00	1.20
F	批发和零售业	1,774,119.00	0.77
G	交通运输、仓储和邮政业	5,058,924.00	2.19
H	住宿和餐饮业	104,909.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,744,870.99	5.52
J	金融业	22,015,487.00	9.54
K	房地产业	1,267,085.00	0.55
L	租赁和商务服务业	1,644,759.60	0.71
M	科学研究和技术服务业	2,707,132.00	1.17
N	水利、环境和公共设施管理业	391,797.60	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	75,960.00	0.03
Q	卫生和社会工作	447,001.00	0.19
R	文化、体育和娱乐业	173,067.00	0.07
S	综合	411,450.00	0.18
	合计	226,796,884.95	98.28

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	25,510.20	0.01
C	制造业	1,167,434.27	0.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	44,211.03	0.02

E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,583.46	0.00
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	1,238,738.96	0.54

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	7,600	9,652,000.00	4.18
2	300750	宁德时代	18,100	7,113,481.00	3.08
3	300502	新易盛	9,584	5,817,488.00	2.52
4	600519	贵州茅台	4,262	5,052,558.38	2.19
5	603986	兆易创新	4,600	3,749,000.00	1.62
6	688256	寒武纪	2,188	3,491,063.40	1.51
7	601318	中国平安	73,100	3,489,794.00	1.51
8	600036	招商银行	84,800	3,010,400.00	1.30
9	601899	紫金矿业	112,900	2,838,306.00	1.23
10	002371	北方华创	2,920	2,582,915.20	1.12
11	000333	美的集团	33,300	2,515,149.00	1.09
12	002475	立讯精密	35,005	2,464,352.00	1.07
13	688008	澜起科技	7,863	2,436,743.70	1.06
14	688012	中微公司	5,057	2,369,204.50	1.03
15	688041	海光信息	6,330	2,343,999.00	1.02
16	002384	东山精密	8,700	2,282,445.00	0.99
17	600900	长江电力	83,800	2,218,186.00	0.96
18	000725	京东方 A	248,900	2,160,452.00	0.94
19	688981	中芯国际	13,580	2,156,775.60	0.93

20	603259	药明康德	16,900	2,104,219.00	0.91
21	600030	中信证券	66,900	1,922,037.00	0.83
22	601166	兴业银行	116,000	1,920,960.00	0.83
23	300059	东方财富	86,700	1,766,946.00	0.77
24	600183	生益科技	9,900	1,716,660.00	0.74
25	600276	恒瑞医药	30,600	1,592,424.00	0.69
26	300274	阳光电源	10,000	1,590,200.00	0.69
27	601398	工商银行	221,800	1,568,126.00	0.68
28	300408	三环集团	9,200	1,535,480.00	0.67
29	002594	比亚迪	18,600	1,482,420.00	0.64
30	600487	亨通光电	13,500	1,476,090.00	0.64
31	300476	胜宏科技	4,200	1,455,006.00	0.63
32	601211	国泰海通	77,500	1,410,500.00	0.61
33	002463	沪电股份	9,200	1,405,760.00	0.61
34	300394	天孚通信	4,492	1,359,638.56	0.59
35	688498	源杰科技	700	1,320,200.00	0.57
36	688525	佰维存储	2,600	1,286,298.00	0.56
37	000988	华工科技	6,900	1,273,809.00	0.55
38	301308	江波龙	1,700	1,196,460.00	0.52
39	601288	农业银行	196,900	1,195,183.00	0.52
40	600176	中国巨石	16,300	1,187,944.00	0.51
41	601328	交通银行	182,800	1,175,404.00	0.51
42	000651	格力电器	30,700	1,151,250.00	0.50
43	600522	中天科技	18,700	1,134,716.00	0.49
44	603019	中科曙光	10,000	1,072,300.00	0.46
45	688521	芯原股份	2,836	1,052,553.04	0.46
46	603993	洛阳钼业	59,800	1,049,490.00	0.45
47	600150	中国船舶	30,908	1,044,381.32	0.45
48	600887	伊利股份	43,300	1,037,468.00	0.45
49	688072	拓荆科技	1,239	1,030,848.00	0.45
50	300604	长川科技	3,000	1,024,260.00	0.44
51	600584	长电科技	9,800	1,014,790.00	0.44
52	000338	潍柴动力	36,900	1,005,525.00	0.44
53	000858	五 粮 液	13,300	984,200.00	0.43
54	688347	华虹宏力	2,831	952,065.30	0.41
55	601816	京沪高铁	201,400	912,342.00	0.40
56	600309	万华化学	12,900	882,489.00	0.38
57	688120	华海清科	2,680	863,442.40	0.37
58	300124	汇川技术	13,000	862,290.00	0.37
59	002415	海康威视	25,100	858,420.00	0.37
60	002916	深南电路	1,870	856,273.00	0.37
61	002281	光迅科技	3,300	847,902.00	0.37
62	002008	大族激光	5,600	840,616.00	0.36

63	600111	北方稀土	17,300	831,265.00	0.36
64	000100	TCL科技	142,500	829,350.00	0.36
65	000063	中兴通讯	22,100	799,799.00	0.35
66	300136	信维通信	6,600	787,050.00	0.34
67	600000	浦发银行	91,300	786,093.00	0.34
68	300857	协创数据	2,300	781,770.00	0.34
69	600089	特变电工	34,600	778,500.00	0.34
70	601857	中国石油	88,800	770,784.00	0.33
71	002028	思源电气	4,300	743,900.00	0.32
72	601088	中国神华	18,800	733,952.00	0.32
73	300433	蓝思科技	13,600	729,776.00	0.32
74	600031	三一重工	40,600	701,568.00	0.30
75	300475	香农芯创	2,300	690,000.00	0.30
76	300014	亿纬锂能	10,400	676,312.00	0.29
77	300223	北京君正	2,700	672,030.00	0.29
78	002050	三花智控	15,300	670,599.00	0.29
79	601601	中国太保	23,400	667,368.00	0.29
80	000001	平安银行	66,400	667,320.00	0.29
81	000792	盐湖股份	21,700	655,123.00	0.28
82	002714	牧原股份	18,700	654,313.00	0.28
83	600549	厦门钨业	7,600	647,520.00	0.28
84	002353	杰瑞股份	4,200	640,500.00	0.28
85	002156	通富微电	8,300	629,721.00	0.27
86	600406	国电南瑞	27,500	628,375.00	0.27
87	601668	中国建筑	141,800	615,412.00	0.27
88	000657	中钨高新	6,200	593,464.00	0.26
89	002436	兴森科技	11,600	591,020.00	0.26
90	300760	迈瑞医疗	4,200	570,486.00	0.25
91	601919	中远海控	43,000	570,180.00	0.25
92	002602	世纪华通	40,400	569,640.00	0.25
93	601988	中国银行	98,000	560,560.00	0.24
94	600660	福耀玻璃	11,000	554,840.00	0.24
95	601728	中国电信	106,500	552,735.00	0.24
96	300054	鼎龙股份	5,200	551,044.00	0.24
97	603501	豪威集团	5,800	550,130.00	0.24
98	601012	隆基绿能	41,500	544,480.00	0.24
99	601225	陕西煤业	26,500	539,275.00	0.23
100	002230	科大讯飞	13,100	535,004.00	0.23
101	600941	中国移动	6,200	534,006.00	0.23
102	600690	海尔智家	25,700	524,537.00	0.23
103	002352	顺丰控股	16,500	515,790.00	0.22
104	601985	中国核电	56,300	508,389.00	0.22
105	002938	鹏鼎控股	4,800	505,824.00	0.22

106	688777	中控技术	4,291	504,192.50	0.22
107	002709	天赐材料	9,800	504,014.00	0.22
108	002460	赣锋锂业	7,700	503,580.00	0.22
109	603799	华友钴业	10,400	501,904.00	0.22
110	300033	同花顺	2,060	496,460.00	0.22
111	300757	罗博特科	800	495,200.00	0.21
112	600160	巨化股份	9,300	492,993.00	0.21
113	000977	浪潮信息	7,000	490,000.00	0.21
114	002851	麦格米特	2,800	468,104.00	0.20
115	300442	润泽科技	5,600	465,192.00	0.20
116	000425	徐工机械	56,100	453,849.00	0.20
117	000938	紫光股份	15,700	453,102.00	0.20
118	002202	金风科技	18,900	451,710.00	0.20
119	688126	沪硅产业	11,283	450,078.87	0.20
120	601600	中国铝业	54,300	446,346.00	0.19
121	600938	中国海油	16,400	445,260.00	0.19
122	600028	中国石化	99,600	444,216.00	0.19
123	300346	南大光电	4,700	435,455.00	0.19
124	002466	天齐锂业	7,100	435,372.00	0.19
125	002600	领益智造	25,000	433,500.00	0.19
126	601766	中国中车	83,300	433,160.00	0.19
127	600460	士兰微	7,900	431,814.00	0.19
128	600050	中国联通	106,900	427,600.00	0.19
129	300661	圣邦股份	2,960	424,700.80	0.18
130	002049	紫光国微	4,700	417,125.00	0.18
131	002837	英维克	5,240	416,894.40	0.18
132	300567	精测电子	1,300	412,880.00	0.18
133	002407	多氟多	8,200	411,886.00	0.18
134	002185	华天科技	18,200	406,042.00	0.18
135	002080	中材科技	4,500	405,000.00	0.18
136	601628	中国人寿	11,400	402,990.00	0.17
137	002138	顺络电子	5,500	402,050.00	0.17
138	002179	中航光电	8,700	401,940.00	0.17
139	688002	睿创微纳	2,589	400,492.41	0.17
140	601100	恒立液压	3,700	397,972.00	0.17
141	300395	菲利华	2,900	387,817.00	0.17
142	000568	泸州老窖	5,000	387,600.00	0.17
143	600879	航天电子	18,100	385,349.00	0.17
144	002241	歌尔股份	17,100	385,263.00	0.17
145	601872	招商轮船	21,900	384,783.00	0.17
146	603288	海天味业	11,400	378,024.00	0.16
147	601006	大秦铁路	81,800	377,098.00	0.16
148	688017	绿的谐波	900	376,074.00	0.16

149	000408	藏格矿业	5,400	374,328.00	0.16
150	300390	天华新能	4,000	374,040.00	0.16
151	605117	德业股份	3,516	373,328.88	0.16
152	601658	邮储银行	75,500	372,215.00	0.16
153	688396	华润微	3,781	368,836.55	0.16
154	688469	芯联集成	34,400	364,984.00	0.16
155	600905	三峡能源	98,000	363,580.00	0.16
156	601888	中国中免	6,700	359,857.00	0.16
157	600489	中金黄金	19,900	359,195.00	0.16
158	002625	光启技术	11,800	357,776.00	0.16
159	688271	联影医疗	3,498	354,102.54	0.15
160	000630	铜陵有色	55,300	351,708.00	0.15
161	600893	航发动力	9,100	348,894.00	0.15
162	600010	包钢股份	155,300	346,319.00	0.15
163	600673	东阳光	10,300	345,874.00	0.15
164	601127	赛力斯	5,600	343,000.00	0.15
165	300058	蓝色光标	24,660	339,321.60	0.15
166	300751	迈为股份	1,200	338,952.00	0.15
167	688111	金山办公	1,585	337,684.25	0.15
168	002273	水晶光电	9,500	337,060.00	0.15
169	002027	分众传媒	69,300	335,412.00	0.15
170	300037	新宙邦	3,600	334,260.00	0.14
171	601689	拓普集团	5,900	332,878.00	0.14
172	600118	中国卫星	4,000	328,200.00	0.14
173	600019	宝钢股份	59,900	325,257.00	0.14
174	600760	中航沈飞	7,800	320,580.00	0.14
175	000426	兴业银锡	9,700	319,712.00	0.14
176	000807	云铝股份	14,300	316,602.00	0.14
177	601168	西部矿业	11,500	312,110.00	0.14
178	600362	江西铜业	7,100	307,430.00	0.13
179	600989	宝丰能源	15,100	306,983.00	0.13
180	600104	上汽集团	31,400	306,464.00	0.13
181	300450	先导智能	7,500	305,400.00	0.13
182	601727	上海电气	43,200	302,400.00	0.13
183	600988	赤峰黄金	11,400	300,048.00	0.13
184	002001	新 和 成	10,552	299,887.84	0.13
185	600875	东方电气	10,400	299,208.00	0.13
186	002738	中矿资源	5,000	294,950.00	0.13
187	688099	晶晨股份	2,853	293,573.70	0.13
188	002422	科伦药业	7,600	292,752.00	0.13
189	605589	圣泉集团	4,600	292,422.00	0.13
190	601390	中国中铁	70,000	291,900.00	0.13
191	600667	太极实业	10,000	291,800.00	0.13

192	600885	宏发股份	8,460	291,785.40	0.13
193	002126	银轮股份	5,800	288,840.00	0.13
194	000538	云南白药	6,097	288,814.89	0.13
195	600795	国电电力	61,300	286,271.00	0.12
196	600547	山东黄金	12,392	286,131.28	0.12
197	000960	锡业股份	6,700	286,023.00	0.12
198	600392	盛和资源	9,600	285,792.00	0.12
199	000831	中国稀土	5,100	282,999.00	0.12
200	600418	江淮汽车	10,800	278,964.00	0.12
201	600585	海螺水泥	16,400	277,980.00	0.12
202	601669	中国电建	58,900	276,830.00	0.12
203	002648	卫星化学	11,600	272,484.00	0.12
204	300316	晶盛机电	4,500	271,800.00	0.12
205	600141	兴发集团	5,700	267,729.00	0.12
206	002812	恩捷股份	4,000	267,640.00	0.12
207	002129	TCL中环	22,200	266,844.00	0.12
208	301358	湖南裕能	3,500	265,545.00	0.12
209	600096	云天化	8,700	264,480.00	0.11
210	300015	爱尔眼科	32,000	264,320.00	0.11
211	601179	中国西电	17,400	259,608.00	0.11
212	300782	卓胜微	2,340	256,417.20	0.11
213	600482	中国动力	7,800	255,840.00	0.11
214	601868	中国能建	95,800	255,786.00	0.11
215	600346	恒力石化	14,400	255,024.00	0.11
216	002195	岩山科技	38,800	253,752.00	0.11
217	000066	中国长城	13,200	251,460.00	0.11
218	002558	巨人网络	9,100	250,796.00	0.11
219	600497	驰宏锌锗	20,700	250,677.00	0.11
220	300418	昆仑万维	6,200	250,232.00	0.11
221	600580	卧龙电驱	7,500	248,250.00	0.11
222	600426	华鲁恒升	10,200	243,984.00	0.11
223	600066	宇通客车	9,100	243,971.00	0.11
224	000625	长安汽车	33,900	243,063.00	0.11
225	600157	永泰能源	149,300	240,373.00	0.10
226	002532	天山铝业	22,200	238,206.00	0.10
227	600221	海航控股	175,700	237,195.00	0.10
228	000157	中联重科	34,000	236,980.00	0.10
229	600895	张江高科	6,300	234,675.00	0.10
230	600711	盛屯矿业	21,200	232,564.00	0.10
231	002340	格林美	35,100	232,011.00	0.10
232	600436	片仔癀	2,100	229,488.00	0.10
233	600011	华能国际	30,200	229,218.00	0.10
234	300803	指南针	2,500	229,175.00	0.10

235	000933	神火股份	10,800	228,960.00	0.10
236	688036	传音控股	3,882	228,843.90	0.10
237	600048	保利发展	49,100	227,333.00	0.10
238	002821	凯莱英	1,400	226,800.00	0.10
239	600143	金发科技	14,600	225,570.00	0.10
240	605499	东鹏饮料	1,819	224,519.17	0.10
241	600438	通威股份	18,500	224,035.00	0.10
242	600115	中国东航	58,500	222,885.00	0.10
243	002236	大华股份	13,500	222,615.00	0.10
244	300017	网宿科技	17,100	222,471.00	0.10
245	002131	利欧股份	46,400	220,400.00	0.10
246	600570	恒生电子	10,400	220,376.00	0.10
247	002493	荣盛石化	20,500	220,375.00	0.10
248	600886	国投电力	16,400	218,284.00	0.09
249	688047	龙芯中科	1,410	218,084.70	0.09
250	600352	浙江龙盛	17,900	216,769.00	0.09
251	002456	欧菲光	22,900	216,634.00	0.09
252	688213	思特威	2,020	216,281.40	0.09
253	688235	百济神州	844	214,890.84	0.09
254	601233	桐昆股份	9,800	212,170.00	0.09
255	300339	润和软件	5,500	211,805.00	0.09
256	603659	璞泰来	7,300	211,189.00	0.09
257	003816	中国广核	53,700	209,967.00	0.09
258	601360	三六零	24,000	208,560.00	0.09
259	601058	赛轮轮胎	18,000	207,540.00	0.09
260	000301	东方盛虹	18,100	207,245.00	0.09
261	300759	康龙化成	7,100	205,403.00	0.09
262	688578	艾力斯	1,877	204,968.40	0.09
263	600026	中远海能	11,400	204,516.00	0.09
264	002074	国轩高科	7,400	203,574.00	0.09
265	688122	西部超导	3,198	200,866.38	0.09
266	002555	三七互娱	10,600	200,022.00	0.09
267	300438	鹏辉能源	2,400	198,840.00	0.09
268	600009	上海机场	8,500	196,350.00	0.09
269	600196	复星医药	8,700	195,489.00	0.08
270	002472	双环传动	4,700	195,097.00	0.08
271	000768	中航西飞	9,500	194,560.00	0.08
272	000975	山金国际	11,400	193,800.00	0.08
273	601111	中国国航	32,000	193,600.00	0.08
274	300001	特锐德	5,100	192,933.00	0.08
275	600415	小商品城	18,900	192,024.00	0.08
276	300207	欣旺达	10,100	191,799.00	0.08
277	600029	南方航空	36,800	190,624.00	0.08

278	002517	恺英网络	11,700	190,125.00	0.08
279	600674	川投能源	13,400	189,878.00	0.08
280	300458	全志科技	4,800	189,408.00	0.08
281	600219	南山铝业	47,400	189,126.00	0.08
282	601186	中国铁建	31,600	188,020.00	0.08
283	002601	龙佰集团	11,400	187,872.00	0.08
284	002128	电投能源	8,100	187,272.00	0.08
285	601877	正泰电器	7,400	185,518.00	0.08
286	600233	圆通速递	11,700	184,275.00	0.08
287	002595	豪迈科技	3,945	183,837.00	0.08
288	601117	中国化学	25,000	183,750.00	0.08
289	300115	长盈精密	6,500	181,610.00	0.08
290	600372	中航机载	16,700	181,195.00	0.08
291	603129	春风动力	700	179,060.00	0.08
292	002155	湖南黄金	7,500	179,025.00	0.08
293	301236	软通动力	4,200	178,290.00	0.08
294	600839	四川长虹	25,200	175,896.00	0.08
295	300568	星源材质	9,300	174,096.00	0.08
296	002465	海格通信	13,600	173,672.00	0.08
297	300454	深信服	1,796	172,775.20	0.07
298	000547	航天发展	8,820	168,903.00	0.07
299	000963	华东医药	6,000	168,720.00	0.07
300	300347	泰格医药	3,500	168,000.00	0.07
301	600741	华域汽车	10,800	167,616.00	0.07
302	603650	彤程新材	1,700	166,566.00	0.07
303	002130	沃尔核材	8,700	164,952.00	0.07
304	300024	机器人	8,500	164,305.00	0.07
305	002920	德赛西威	2,000	163,000.00	0.07
306	002497	雅化集团	7,900	160,923.00	0.07
307	688676	金盘科技	1,900	160,816.00	0.07
308	001979	招商蛇口	24,800	159,464.00	0.07
309	300012	华测检测	11,500	159,390.00	0.07
310	000878	云南铜业	10,000	158,800.00	0.07
311	300866	安克创新	1,500	156,750.00	0.07
312	002271	东方雨虹	13,200	156,684.00	0.07
313	002432	九安医疗	2,200	155,496.00	0.07
314	300083	创世纪	11,400	155,268.00	0.07
315	601021	春秋航空	3,400	154,972.00	0.07
316	000034	神州数码	5,580	154,845.00	0.07
317	300496	中科创达	2,500	154,475.00	0.07
318	002414	高德红外	11,600	153,816.00	0.07
319	603979	金诚信	2,600	153,478.00	0.07
320	000733	振华科技	2,700	152,928.00	0.07

321	002444	巨星科技	4,900	152,390.00	0.07
322	300474	景嘉微	2,500	151,200.00	0.07
323	601319	中国人保	21,900	148,044.00	0.06
324	688266	泽璟制药	1,266	147,691.56	0.06
325	002756	永兴材料	2,600	147,264.00	0.06
326	688331	荣昌生物	1,128	146,933.28	0.06
327	000661	长春高新	2,200	146,520.00	0.06
328	688506	百利天恒	498	146,426.94	0.06
329	300748	金力永磁	4,700	144,995.00	0.06
330	002025	航天电器	1,900	144,818.00	0.06
331	600699	均胜电子	6,700	144,787.00	0.06
332	300763	锦浪科技	1,600	144,560.00	0.06
333	300073	当升科技	3,000	144,120.00	0.06
334	002078	太阳纸业	11,500	143,635.00	0.06
335	601615	明阳智能	12,300	142,311.00	0.06
336	603606	东方电缆	3,420	141,964.20	0.06
337	603087	甘李药业	2,500	141,900.00	0.06
338	300142	沃森生物	10,900	141,591.00	0.06
339	601677	明泰铝业	8,500	141,100.00	0.06
340	300432	富临精工	7,000	140,630.00	0.06
341	000423	东阿阿胶	3,100	140,616.00	0.06
342	300919	中伟新材	3,200	140,000.00	0.06
343	600039	四川路桥	17,900	139,978.00	0.06
344	601800	中国交建	24,300	138,753.00	0.06
345	000002	万　科A	46,600	137,936.00	0.06
346	002252	上海莱士	31,500	136,710.00	0.06
347	600226	亨通股份	14,100	135,219.00	0.06
348	688169	石头科技	1,423	135,142.31	0.06
349	688599	天合光能	9,543	134,747.16	0.06
350	300724	捷佳伟创	1,900	134,140.00	0.06
351	688223	晶科能源	28,051	133,242.25	0.06
352	688608	恒玄科技	793	132,581.67	0.06
353	688390	固德威	1,201	130,320.51	0.06
354	601633	长城汽车	8,600	129,774.00	0.06
355	688188	柏楚电子	1,215	129,640.50	0.06
356	600588	用友网络	14,100	129,438.00	0.06
357	002064	华峰化学	13,600	129,064.00	0.06
358	001965	招商公路	14,000	128,240.00	0.06
359	688180	君实生物	3,756	127,027.92	0.06
360	000786	北新建材	7,000	126,630.00	0.05
361	002831	裕同科技	3,500	124,460.00	0.05
362	300677	英科医疗	3,100	121,427.00	0.05
363	300972	万辰集团	700	121,387.00	0.05

364	002294	信立泰	3,800	121,182.00	0.05
365	600516	方大炭素	19,500	120,315.00	0.05
366	601607	上海医药	7,800	120,120.00	0.05
367	000519	中兵红箭	5,700	120,099.00	0.05
368	600177	雅戈尔	15,900	119,727.00	0.05
369	603806	福斯特	7,100	119,209.00	0.05
370	601618	中国中冶	48,500	118,340.00	0.05
371	002176	江特电机	11,800	118,118.00	0.05
372	302132	中航成飞	2,000	116,640.00	0.05
373	688065	凯赛生物	2,424	115,988.40	0.05
374	603260	合盛硅业	2,400	115,824.00	0.05
375	000623	吉林敖东	6,500	115,245.00	0.05
376	000617	中油资本	17,400	114,666.00	0.05
377	300699	光威复材	4,000	114,600.00	0.05
378	300832	新产业	2,700	113,400.00	0.05
379	002085	万丰奥威	10,200	113,118.00	0.05
380	002318	久立特材	4,700	112,330.00	0.05
381	300251	光线传媒	10,000	110,900.00	0.05
382	300558	贝达药业	1,700	110,619.00	0.05
383	002459	晶澳科技	13,500	109,350.00	0.05
384	600499	科达制造	7,900	109,020.00	0.05
385	600085	同仁堂	4,700	108,617.00	0.05
386	002065	东华软件	15,200	108,528.00	0.05
387	002266	浙富控股	21,400	108,284.00	0.05
388	603596	伯特利	4,356	108,203.04	0.05
389	002044	美年健康	21,500	108,145.00	0.05
390	300342	天银机电	2,300	108,100.00	0.05
391	600515	海南机场	39,400	107,956.00	0.05
392	605090	九丰能源	2,900	107,793.00	0.05
393	688472	阿特斯	9,900	107,118.00	0.05
394	000400	许继电气	4,900	106,330.00	0.05
395	300409	道氏技术	5,300	105,629.00	0.05
396	300003	乐普医疗	8,900	105,465.00	0.05
397	002223	鱼跃医疗	4,100	105,206.00	0.05
398	688005	容百科技	3,436	105,141.60	0.05
399	000032	深桑达A	4,200	104,790.00	0.05
400	600862	中航高科	5,800	104,574.00	0.05
401	000683	博源化工	18,100	104,256.00	0.05
402	002405	四维图新	16,100	104,167.00	0.05
403	600521	华海药业	7,200	103,680.00	0.04
404	000415	渤海租赁	25,400	103,378.00	0.04
405	601216	君正集团	23,100	103,026.00	0.04
406	000039	中集集团	12,600	102,186.00	0.04

407	600704	物产中大	21,500	101,480.00	0.04
408	000999	华润三九	4,500	101,205.00	0.04
409	600803	新奥股份	6,400	101,120.00	0.04
410	301550	斯菱智驱	1,100	100,573.00	0.04
411	603766	隆鑫通用	8,400	100,212.00	0.04
412	000887	中鼎股份	5,500	98,395.00	0.04
413	000967	盈峰环境	9,300	97,929.00	0.04
414	600018	上港集团	20,700	97,704.00	0.04
415	600312	平高电气	5,500	97,130.00	0.04
416	300122	智飞生物	8,300	97,027.00	0.04
417	600765	中航重机	7,500	96,900.00	0.04
418	600332	白云山	4,800	96,192.00	0.04
419	603605	珀莱雅	1,600	95,872.00	0.04
420	688116	天奈科技	2,506	95,729.20	0.04
421	600153	建发股份	11,900	94,367.00	0.04
422	600166	福田汽车	32,300	93,993.00	0.04
423	000830	鲁西化工	7,800	93,600.00	0.04
424	600323	瀚蓝环境	3,400	93,364.00	0.04
425	002410	广联达	11,200	91,392.00	0.04
426	601799	星宇股份	1,000	90,620.00	0.04
427	002007	华兰生物	7,400	90,206.00	0.04
428	688617	惠泰医疗	491	89,145.96	0.04
429	688114	华大智造	1,734	88,572.72	0.04
430	300896	爱美客	1,000	87,200.00	0.04
431	603568	伟明环保	5,620	86,435.60	0.04
432	600398	海澜之家	16,500	86,295.00	0.04
433	600486	扬农化工	1,700	86,190.00	0.04
434	002603	以岭药业	5,700	85,500.00	0.04
435	600529	山东药玻	4,600	84,870.00	0.04
436	688009	中国通号	17,765	84,561.40	0.04
437	601000	唐山港	20,200	83,830.00	0.04
438	002389	航天彩虹	4,700	83,519.00	0.04
439	601018	宁波港	26,500	83,475.00	0.04
440	600208	衢州发展	29,400	83,202.00	0.04
441	600008	首创环保	30,400	82,688.00	0.04
442	000738	航发控制	4,500	82,305.00	0.04
443	600998	九州通	17,400	81,606.00	0.04
444	603486	科沃斯	1,600	81,200.00	0.04
445	600316	洪都航空	2,900	81,026.00	0.04
446	000932	华菱钢铁	23,300	80,851.00	0.04
447	600170	上海建工	36,100	80,142.00	0.03
448	600161	天坛生物	6,812	78,882.96	0.03
449	600820	隧道股份	15,100	78,671.00	0.03

450	601238	广汽集团	15,200	77,216.00	0.03
451	300118	东方日升	6,200	77,190.00	0.03
452	603885	吉祥航空	7,500	77,175.00	0.03
453	603816	顾家家居	3,400	76,024.00	0.03
454	002607	中公教育	42,200	75,960.00	0.03
455	688303	大全能源	4,322	75,332.46	0.03
456	600763	通策医疗	2,200	74,536.00	0.03
457	603939	益丰药房	4,100	73,718.00	0.03
458	688166	博瑞医药	2,099	73,485.99	0.03
459	601567	三星电气	4,800	71,712.00	0.03
460	300573	兴齐眼药	1,757	71,615.32	0.03
461	600038	中直股份	2,800	70,812.00	0.03
462	601880	辽港股份	50,900	70,242.00	0.03
463	603392	万泰生物	2,600	70,122.00	0.03
464	300676	华大基因	2,000	70,120.00	0.03
465	300049	福瑞医科	1,800	69,984.00	0.03
466	600535	天士力	5,200	68,796.00	0.03
467	600511	国药股份	2,600	67,704.00	0.03
468	300100	双林股份	2,400	66,672.00	0.03
469	600816	建元信托	27,300	66,612.00	0.03
470	688063	派能科技	1,250	66,587.50	0.03
471	000833	粤桂股份	2,800	65,576.00	0.03
472	002244	滨江集团	8,400	63,840.00	0.03
473	002120	韵达股份	10,000	63,600.00	0.03
474	601155	新城控股	6,100	62,586.00	0.03
475	300144	宋城演艺	10,700	62,167.00	0.03
476	000998	隆平高科	8,000	60,320.00	0.03
477	002544	普天科技	3,300	60,126.00	0.03
478	601866	中远海发	26,800	59,228.00	0.03
479	600064	南京高科	8,300	59,179.00	0.03
480	600635	大众公用	13,400	57,352.00	0.02
481	300457	赢合科技	2,700	56,916.00	0.02
482	600754	锦江酒店	3,100	55,769.00	0.02
483	000035	中国天楹	11,500	55,545.00	0.02
484	600655	豫园股份	13,500	55,485.00	0.02
485	603899	晨光股份	2,600	53,638.00	0.02
486	300601	康泰生物	4,500	51,030.00	0.02
487	600004	白云机场	7,000	50,820.00	0.02
488	600663	陆家嘴	8,000	50,240.00	0.02
489	002091	江苏国泰	6,800	49,164.00	0.02
490	600258	首旅酒店	4,500	49,140.00	0.02
491	600859	王府井	5,300	48,654.00	0.02
492	300070	碧水源	15,100	48,169.00	0.02

493	000069	华侨城A	27,500	45,100.00	0.02
494	600864	哈投股份	8,600	44,634.00	0.02
495	301078	孩子王	6,100	41,236.00	0.02
496	002292	奥飞娱乐	6,000	39,360.00	0.02
497	603833	欧派家居	1,300	39,143.00	0.02
498	600325	华发股份	15,400	35,574.00	0.02
499	002891	中宠股份	1,300	34,736.00	0.02
500	002572	索菲亚	4,000	29,200.00	0.01

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

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	688795	摩尔线程	394	266,714.36	0.12
2	301666	大普微	462	214,058.46	0.09
3	688781	视涯科技	2,647	111,597.52	0.05
4	688808	联讯仪器	51	80,800.83	0.04
5	688818	电科蓝天	739	51,833.46	0.02
6	688820	盛合晶微	359	50,794.91	0.02
7	001248	华润新能源	4,373	44,211.03	0.02
8	301682	宏明电子	276	44,176.56	0.02
9	688790	昂瑞微	319	40,337.55	0.02
10	688813	泰金新能	228	39,236.52	0.02
11	688712	北芯生命	1,092	39,224.64	0.02
12	688785	恒运昌	65	30,104.75	0.01
13	001257	盛龙股份	1,230	25,510.20	0.01
14	688811	有研复材	834	20,124.42	0.01
15	688797	臻宝科技	42	19,684.14	0.01
16	688635	长进光子	59	18,183.21	0.01
17	603459	红板科技	210	17,707.20	0.01
18	301696	三瑞智能	195	16,926.00	0.01
19	301687	新广益	173	13,455.94	0.01
20	301680	固德电材	95	10,655.20	0.00
21	301531	春光集团	194	10,002.64	0.00
22	301683	慧谷新材	67	8,158.59	0.00
23	603407	长裕集团	109	8,007.14	0.00
24	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
25	301669	高特电子	243	6,901.20	0.00
26	301599	理奇智能	203	6,591.41	0.00
27	688816	易思维	104	5,938.40	0.00
28	001365	天海电子	177	5,541.87	0.00
29	001393	维通利	124	4,834.76	0.00
30	001237	惠康科技	73	4,288.02	0.00
31	601112	振石股份	234	4,116.06	0.00
32	603435	嘉德利	79	3,690.09	0.00

33	603352	至信股份	76	1,939.52	0.00
34	603293	埃泰克	48	1,628.64	0.00
35	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
36	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
37	001312	福恩股份	92	1,543.76	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	7,828,938.95	2.97
2	601318	中国平安	4,284,905.00	1.63
3	688041	海光信息	3,756,499.30	1.43
4	601899	紫金矿业	3,731,292.00	1.42
5	600036	招商银行	3,367,623.00	1.28
6	688008	澜起科技	2,440,216.32	0.93
7	600900	长江电力	2,392,906.00	0.91
8	300308	中际旭创	2,314,421.00	0.88
9	603986	兆易创新	2,279,117.00	0.86
10	601166	兴业银行	2,190,578.00	0.83
11	688256	寒武纪	1,998,840.00	0.76
12	688981	中芯国际	1,996,746.37	0.76
13	600030	中信证券	1,746,082.00	0.66
14	601398	工商银行	1,672,906.00	0.63
15	603259	药明康德	1,565,378.00	0.59
16	600276	恒瑞医药	1,542,463.00	0.59
17	600183	生益科技	1,446,652.00	0.55
18	600309	万华化学	1,384,056.00	0.53
19	601211	国泰海通	1,372,363.00	0.52
20	601288	农业银行	1,332,450.00	0.51

注：“买入金额”是指买入股票成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

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	600519	贵州茅台	10,260,191.52	3.89
2	601318	中国平安	5,717,129.00	2.17
3	601899	紫金矿业	5,088,351.00	1.93
4	600036	招商银行	4,479,091.00	1.70
5	688041	海光信息	4,175,577.68	1.58
6	600900	长江电力	3,102,722.00	1.18
7	601166	兴业银行	2,881,103.00	1.09
8	688008	澜起科技	2,579,934.89	0.98
9	688981	中芯国际	2,294,925.71	0.87

10	688256	寒武纪	2,290,463.59	0.87
11	300308	中际旭创	2,283,480.00	0.87
12	603259	药明康德	2,277,061.00	0.86
13	600276	恒瑞医药	2,265,177.00	0.86
14	600030	中信证券	2,252,139.00	0.85
15	603986	兆易创新	2,230,183.20	0.85
16	601398	工商银行	2,225,459.00	0.84
17	601088	中国神华	1,809,069.00	0.69
18	600309	万华化学	1,800,486.00	0.68
19	601288	农业银行	1,769,842.00	0.67
20	601211	国泰海通	1,743,262.00	0.66

注：“卖出金额”是指卖出股票成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

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	162,298,402.36
卖出股票收入（成交）总额	192,037,300.44

注：表中“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（成交）总额”均指成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

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）	25,000.58	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	25,000.58	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	111025	圣泉转债	140	14,000.12	0.01
2	113704	春风转债	110	11,000.46	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

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

无。

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

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地参与股指期货交易。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货交易时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

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

本基金参与国债期货交易是为了有效控制债券市场的系统性风险，本基金将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，适度运用国债期货提高投资组合运作效率。在参与国债期货交易时，基金管理人通过对宏观经济和利率市场走势的分析与判断，并充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置，谨慎进行投资，以调整债券组合的久期，降低投资组合的整体风险。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

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

1.本基金投资的前十名证券中的招商银行，其发行主体为招商银行股份有限公司。根据发布的相关公告，该证券发行主体因未依法履行职责，受到金融监管总局的处罚。

投资决策说明：本基金投资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要求。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

无。

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	-
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	60,492.63
8	其他	-
9	合计	60,492.63

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

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

无。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688795	摩尔线程	266,714.36	0.12	首发流通受限
2	301666	大普微	214,058.46	0.09	首发流通受限
3	688781	视涯科技	111,597.52	0.05	首发流通受限
4	688808	联讯仪器	80,800.83	0.04	首发流通受限
5	688818	电科蓝天	51,833.46	0.02	首发流通受限

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§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	
		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
250	623,285.88	149,363,105.00	95.86	6,458,366.00	4.14

8.2 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	-	-

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2025年1月9日）基金份额总额	1,067,821,471.00
本报告期期初基金份额总额	203,821,471.00
本报告期基金总申购份额	144,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	192,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	155,821,471.00

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，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

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，本基金的基金管理人无重大人事变动。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产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

本基金聘请的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
国投证券	6	353,054,160.51	100.00	69,169.08	100.00	-

注：1.本基金使用券商交易模式。

2.本基金选择的券商为国投证券。本基金管理人与国投证券不存在关联方关系。

3.券商交易模式下的券商选择标准为：

（1）财务状况良好，最近一年经审计的净资产原则上不低于 20 亿元；

（2）经营行为规范，最近一年内不存在可能影响证券研究服务和经纪业务稳定性的重大行政处罚或者刑事处罚；

（3）不存在对拟提供交易、研究服务已经造成或者可能造成不良影响的诉讼、仲裁或其他重大事项；

（4）合规风控能力和交易等服务能力较强；

（5）拥有良好的公司声誉；

（6）交易、研究等服务能力较强，具有全面综合的研究服务能力，或在具体领域具有突出的特色研究服务，或能够提供较好的交易服务，有稳定的研究机构和专业的研究人员，能及时为本公司提供高质量的研究支持与服务，包括宏观与策略报告、行业与公司分析报告、债券市场分析报告和金融衍生品分析报告等，并能根据基金投资的特定需求，提供专门研究报告；

（7）券商分类监管评级原则上不得为 D 及以下。

4.券商交易模式下的券商选择程序为：

（1）本基金管理人根据上述标准对券商进行考察评价后，经公司内部审批程序确定选用的券商；

（2）本基金管理人和被选中的券商签订经纪服务协议。

5.交易单元变更情况

本基金本报告期新增国投证券交易单元 2 个。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
国投证券	25,000.00	100.00	-	-	-	-

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	融通基金管理有限公司关于取消监事暨监事离任公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 1 月 9 日
2	融通基金管理有限公司关于旗下部分深交所 ETF 新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 1 月 20 日
3	融通基金管理有限公司关于融通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 1 月 31 日
4	融通基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 3 月 31 日
5	融通基金管理有限公司关于旗下部分深交所 ETF 新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 4 月 9 日
6	2025 年度融通基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 4 月 30 日
7	融通基金管理有限公司关于暂停中证金牛（北京）基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 30 日
8	融通基金管理有限公司关于终止与中证金牛（北京）基金销售有限公司相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 5 日
9	融通基金管理有限公司关于旗下部分基金流动性服务商终止的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 26 日
10	融通基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 30 日

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
机构	1	20260101-20260630	162,995,971.00	91,711,200.00	118,499,200.00	136,207,971.00	87.41
	2	20260305-20260528	23,844,600.00	34,197,000.00	50,968,500.00	7,073,100.00	4.54

产品特有风险
当基金份额持有人占比过于集中时，可能存在因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金份额净值剧烈波动的风险及流动性风险。

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

（一）中国证监会准予融通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金注册的文件

（二）《融通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

（三）《融通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

（四）《融通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及其更新

（五）融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照

（六）报告期内在指定报刊上披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

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，或登录本基金管理人网站 http://www.rtfund.com 查阅。

融通基金管理有限公司

2026 年 8 月 28 日