

国寿安保中证 500 交易型开放式
指数证券投资基金
2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：国寿安保基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 08 月 29 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 2025 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
3.3 其他指标	7
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	10
§ 5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	10
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	11
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	15
§ 7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	50
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	50
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	50
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50

7.12 投资组合报告附注	50
§ 8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末上市基金前十名持有人	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	52
§ 9 开放式基金份额变动	52
§ 10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4 基金投资策略的改变	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
10.8 其他重大事件	55
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	55
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	55
§ 12 备查文件目录	55
12.1 备查文件目录	55
12.2 存放地点	56
12.3 查阅方式	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	国寿安保中证 500ETF
场内简称	国寿 500ETF
基金主代码	510560
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 29 日
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	126,318,687.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2015 年 7 月 3 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求偏离度和误差最小化。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。
业绩比较基准	中证 500 指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相近的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国寿安保基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	韩占锋	任航
	联系电话	010-50850744	010-66060069
	电子邮箱	public@gsfunds.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4009-258-258	95599
传真		010-50850776	010-68121816
注册地址		上海市虹口区丰镇路806号3幢306号	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址		北京市西城区金融大街28号院盈泰商务中心2号楼11层	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		100033	100031
法定代表人		于泳	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.gsfunds.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 1 月 1 日 - 2025 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,759,745.69
本期利润	9,493,387.29
加权平均基金份额本期利润	0.0746
本期加权平均净值利润率	5.49%
本期基金份额净值增长率	5.53%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-94,012,046.50
期末可供分配基金份额利润	-0.7442
期末基金资产净值	178,795,866.13
期末基金份额净值	1.4154
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-34.46%

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	5.22%	0.77%	4.31%	0.79%	0.91%	-0.02%
过去三个月	2.45%	1.48%	0.98%	1.50%	1.47%	-0.02%
过去六个月	5.53%	1.34%	3.31%	1.36%	2.22%	-0.02%
过去一年	25.26%	1.70%	19.68%	1.72%	5.58%	-0.02%

过去三年	-1.32%	1.34%	-8.35%	1.35%	7.03%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-34.46%	1.57%	-40.06%	1.60%	5.60%	-0.03%

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

国寿安保中证500ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日为 2015 年 05 月 29 日，按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起 3 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同关于投资范围和投资限制的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。图示日期为 2015 年 05 月 29 日至 2025 年 06 月 30 日。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2025 年 6 月 30 日，公司共管理 105 只公募证券投资基金和部分私募资产管理计划，公司管理资产总规模为 4121.48 亿元，其中公募证券投资基金管理规模为 3406.36 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李康	基金经理	2015 年 5 月 29 日	-	16 年	博士研究生，曾任中国国际金融有限公司量化投资研究员、长盛基金管理有限公司金融工程研究员。2013 年 11 月加入国寿安保基金管理有限公司，历任基金经理助理、基金经理，现任国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保国证创业板中盘精选 88 交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金和国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金和国寿安保稳泽两年持有期混合型证券投资基金基金经理。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于基金份额持有人为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，本基金严格遵守基金合同，紧密追踪标的指数。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.4154 元；本报告期基金份额净值增长率为 5.53%，业绩比较基准收益率为 3.31%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国内宏观经济稳中向好，2025 年上半年 GDP 增长 5.3%，政策聚焦全方位扩大内需以旧换新对消费形成有力支撑，抢出口等因素下贸易顺差同比大幅增长。一季度 DeepSeek 带动 AI 和机器人等科技板块上行，虽然二季度初关税冲击市场大幅下跌，但随后贸易谈判中美阶段性缓和，经济逐渐修复，低利率环境和增量资金入市提振市场。整体看上半年股票市场呈震荡上行态势，沪深 300 指数上涨 0.03%，中证 500 上涨 3.31%，中证 1000 上涨 6.69%，港股表现亮眼，恒生指数和恒生科技分别上涨 20% 和 18.68%。市场结构分化明显，小盘成长整体占优，行业层面有色、银行等表现较好，煤炭、食品饮料跌幅居前。

展望下半年，国内经济韧性较强，全年增长目标完成难度不大。地产行业下行速

率放缓，反内卷治理优化供给结构，有望与扩大内需协同从供需两端缓解结构性矛盾，使得内需渐进修复，技术创新、智能化和绿色低碳等行业预计在十五五规划持续获得产业政策支持，看好科技产业投资价值。宏观层面流动性预计保持宽松，稳增长政策效能持续释放。外部美联储处于降息通道，年初以来人民币汇率显著修复，资金回流将利好股市尤其是港股。低利率环境下权益资产性价比高，随着企业盈利改善叠加股市赚钱效应，有望带动增量资金入市提升估值水平，中长期看权益市场配置价值较为明显。

本基金将严格遵守基金合同，力争将对标的指数的跟踪误差降低到最小程度。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

上述参与估值流程的各方不存在任何重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中

《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—国寿安保基金管理有限公司 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为, 国寿安保基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，国寿安保基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	2,349,734.20	2,915,921.05
结算备付金		-	16,379.08
存出保证金		3,366.50	6,177.49
交易性金融资产	6.4.7.2	176,614,427.47	169,438,460.54
其中：股票投资		176,614,427.47	169,438,460.54
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-

衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
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	-	-
资产总计		178,967,528.17	172,376,938.16
负债和净资产	附注号	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024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		71,114.15	75,255.71
应付托管费		14,222.81	15,051.14
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	86,325.08	181,058.79
负债合计		171,662.04	271,365.64
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	272,807,912.63	277,127,272.16
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-94,012,046.50	-105,021,699.64
净资产合计		178,795,866.13	172,105,572.52
负债和净资产总计		178,967,528.17	172,376,938.16

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.4154 元，基金份额总额 126,318,687.00 份。

6.2 利润表

会计主体：国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		10,106,497.34	-12,100,895.16
1. 利息收入		5,160.09	6,888.43
其中：存款利息收入	6.4.7.13	5,160.09	6,888.43
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）		2,369,166.44	-4,471,851.19
其中：股票投资收益	6.4.7.14	650,084.82	-6,522,645.34
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	11,871.58	6,270.33
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	1,707,210.04	2,044,523.82
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	7,733,641.60	-7,651,045.95
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	-1,470.79	15,113.55
减：二、营业总支出		613,110.05	622,097.72
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	428,029.29	397,030.19
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	85,605.80	79,406.02
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.01	-
8. 其他费用	6.4.7.23	99,474.95	145,661.51
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,493,387.29	-12,722,992.88

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,493,387.29	-12,722,992.88
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		9,493,387.29	-12,722,992.88

6.3 净资产变动表

会计主体：国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 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	277,127,272.16	-	-105,021,699.64	172,105,572.52
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	277,127,272.16	-	-105,021,699.64	172,105,572.52
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-4,319,359.53	-	11,009,653.14	6,690,293.61
（一）、综合收益总额	-	-	9,493,387.29	9,493,387.29
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-4,319,359.53	-	1,516,265.85	-2,803,093.68
其中：1. 基金申购款	-	-	-	-
2. 基金赎回款	-4,319,359.53	-	1,516,265.85	-2,803,093.68
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	272,807,912.63	-	-94,012,046.50	178,795,866.13
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	303,043,429.40	-	-130,955,930.13	172,087,499.27
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本期期初净资产	303,043,429.40	-	-130,955,930.13	172,087,499.27
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-21,596,797.69	-	-3,226,554.30	-24,823,351.99
(一)、综合收益总额	-	-	-12,722,992.88	-12,722,992.88
(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)	-21,596,797.69	-	9,496,438.58	-12,100,359.11
其中：1. 基金申购款	-	-	-	-
2. 基金赎回款	-21,596,797.69	-	9,496,438.58	-12,100,359.11
(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	281,446,631.71	-	-134,182,484.43	147,264,147.28

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：

鄂华
基金管理人负责人

王文英
主管会计工作负责人

于晓树
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书 [2015]268 号核准，本基金 308,318,687.00 份基金份额于 2015 年 7 月 3 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、证券公司短期公司债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、国债期货以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：标的指数，本基金标的指数为中证 500 指数。

本基金的基金管理人国寿安保基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，募集成立了国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“国寿中证 500ETF 联接基金”)。国寿中证 500ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期

末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策和会计估计与上年度会计报表相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。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。

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

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

(4)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	2,349,734.20
等于：本金	2,349,521.87
加：应计利息	212.33
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	2,349,734.20

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		176,709,165.60	-	176,614,427.47	-94,738.13
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		176,709,165.60	-	176,614,427.47	-94,738.13

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

本基金于本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

本基金于本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

本基金于本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本基金于本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 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	18,784.93
其中：交易所市场	18,784.93
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	67,540.15
合计	86,325.08

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	128,318,687.00	277,127,272.16
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-2,000,000.00	-4,319,359.53
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	126,318,687.00	272,807,912.63

6.4.7.11 其他综合收益

本基金于本报告期末无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-60,521,698.00	-44,500,001.64	-105,021,699.64
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-60,521,698.00	-44,500,001.64	-105,021,699.64
本期利润	1,759,745.69	7,733,641.60	9,493,387.29
本期基金份额交易产生的变动数	925,387.52	590,878.33	1,516,265.85

其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	925,387.52	590,878.33	1,516,265.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-57,836,564.79	-36,175,481.71	-94,012,046.50

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	5,092.99
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	58.24
其他	8.86
合计	5,160.09

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 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	669,380.35
股票投资收益——赎回差价收入	-19,295.53
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	650,084.82

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	23,283,523.09
减：卖出股票成本总额	22,590,651.93
减：交易费用	23,490.81
买卖股票差价收入	669,380.35

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 2025年1月1日至2025年6月30日
赎回基金份额对价总额	2,803,093.68

减：现金支付赎回款总额	1,406,219.68
减：赎回股票成本总额	1,416,169.53
减：交易费用	-
赎回差价收入	-19,295.53

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 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	6.87
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	11,864.71
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	11,871.58

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	84,875.17
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	73,000.00
减：应计利息总额	7.07
减：交易费用	3.39
买卖债券差价收入	11,864.71

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

本基金于本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17 贵金属投资收益

本基金本报告期间无贵金属投资收益。

6.4.7.18 衍生工具收益

本基金本报告期间无衍生工具产生的收益/损失。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
----	----------------------------

股票投资产生的股利收益	1,707,210.04
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	1,707,210.04

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	7,733,641.60
股票投资	7,733,641.60
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	7,733,641.60

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	—
替代损益	-1,470.79
合计	-1,470.79

6.4.7.22 信用减值损失

本基金于本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	8,032.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
银行费用	852.49
指数使用费	30,722.31

其他	360.00
合计	99,474.95

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无需作披露的重大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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国寿安保	基金管理人
农业银行	基金托管人
中国人寿资产管理有限公司（简称“国寿资产”）	基金管理人的股东
国家共同基金管理有限公司（简称“国家共同基金”）	基金管理人的股东
中国人寿保险（集团）公司（简称“集团公司”）	基金管理人的最终控制人
中国人寿保险股份有限公司（简称“中国人寿”）	与基金管理人同受集团公司控制的公司
国寿财富管理有限公司（简称“国寿财富”）	基金管理人的子公司
国寿安保中证 500ETF 联接基金	本基金的联接基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	428,029.29	397,030.19

其中：应支付销售机构的客户维护费	1,159.87	-
应支付基金管理人的净管理费	426,869.42	397,030.19

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

$$H=E\times 0.50\%/ \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	85,605.80	79,406.02

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

$$H=E\times 0.10\%/ \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金于本报告期及上年度可比期间均无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

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

本基金于本报告期及上年度可比期间均无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人于本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
国寿安保中证 500ETF联接	122,886,786.00	97.28	125,137,586.00	97.52

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
农业银行	2,349,734.20	5,092.99	1,869,095.29	6,568.02

注：本基金的银行存款由基金托管人农业银行保管，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金于本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金于本报告期间未进行利润分配。

6.4.12 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001335	信凯科技	2025 年 4 月 2 日	6 个月	新股流通受限	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-
001356	富岭股份	2025 年 1 月 16 日	6 个月	新股流通受限	5.30	14.44	427	2,263.10	6,165.88	-
001382	新亚电缆	2025 年 3 月 13 日	6 个月	新股流通受限	7.40	20.21	350	2,590.00	7,073.50	-
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	5 日	新股未上市	16.42	16.42	814	13,365.88	13,365.88	-
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	6 个月	新股流通受限	16.42	16.42	91	1,494.22	1,494.22	-
001390	古麒绒材	2025 年 5 月 21 日	6 个月	新股流通受限	12.08	18.12	144	1,739.52	2,609.28	-
001395	亚联机械	2025 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	19.08	47.25	80	1,526.40	3,780.00	-
301275	汉朔科技	2025 年 3 月 4 日	6 个月	新股流通受限	27.50	56.19	150	4,125.00	8,428.50	-
301458	钧崴电子	2025 年 1 月 2 日	6 个月	新股流通受限	10.40	34.11	512	5,324.80	17,464.32	-
301479	弘景光电	2025 年 3 月 6 日	6 个月	新股流通受限	41.90	77.87	132	3,938.60	10,278.84	锁定期内发生送股
301501	恒鑫生活	2025 年 3 月 11 日	6 个月	新股流通受限	39.92	45.22	145	3,992.00	6,556.90	锁定期内发生送股
301535	浙江华远	2025 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通受限	4.92	18.99	734	3,611.28	13,938.66	-
301560	众捷汽车	2025 年 4 月 17 日	6 个月	新股流通受限	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-
301590	优优绿能	2025 年 5 月 28 日	6 个月	新股流通受限	89.60	139.48	37	3,315.20	5,160.76	-
301595	太力科技	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
301601	惠通科技	2025 年 1 月 8 日	6 个月	新股流通受限	11.80	33.85	342	4,035.60	11,576.70	-

301602	超研股份	2025 年 1 月 15 日	6 个月	新股流通受限	6.70	24.80	658	4,408.60	16,318.40	-
301636	泽润新能	2025 年 4 月 30 日	6 个月	新股流通受限	33.06	47.46	109	3,603.54	5,173.14	-
301658	首航新能	2025 年 3 月 26 日	6 个月	新股流通受限	11.80	22.98	376	4,436.80	8,640.48	-
301662	宏工科技	2025 年 4 月 10 日	6 个月	新股流通受限	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	-
301665	泰禾股份	2025 年 4 月 2 日	6 个月	新股流通受限	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-
301678	新恒汇	2025 年 6 月 13 日	6 个月	新股流通受限	12.80	44.54	250	3,200.00	11,135.00	-
603014	威高血净	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	26.50	32.68	90	2,385.00	2,941.20	-
603049	中策橡胶	2025 年 5 月 27 日	6 个月	新股流通受限	46.50	42.85	75	3,487.50	3,213.75	-
603072	天和磁材	2024 年 12 月 24 日	6 个月	新股流通受限	12.30	54.45	136	1,672.80	7,405.20	-
603120	肯特催化	2025 年 4 月 9 日	6 个月	新股流通受限	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-
603124	江南新材	2025 年 3 月 12 日	6 个月	新股流通受限	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-
603202	天有为	2025 年 4 月 16 日	6 个月	新股流通受限	93.50	90.66	27	2,524.50	2,447.82	-
603210	泰鸿万立	2025 年 4 月 1 日	6 个月	新股流通受限	8.60	15.61	250	2,150.00	3,902.50	-
603257	中国瑞林	2025 年 3 月 28 日	6 个月	新股流通受限	20.52	37.47	69	1,415.88	2,585.43	-
603271	永杰新材	2025 年 3 月 4 日	6 个月	新股流通受限	20.60	35.08	76	1,565.60	2,666.08	-
603382	海阳科技	2025 年 6 月 5 日	6 个月	新股流通受限	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-
603400	华之杰	2025 年 6 月 12 日	6 个月	新股流通受限	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
603409	汇通控股	2025 年 2 月 25 日	6 个月	新股流通受限	24.18	33.32	61	1,474.98	2,032.52	-
688411	海博思创	2025 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	19.38	83.49	314	6,085.32	26,215.86	-
688545	兴福电子	2025 年 1 月 15 日	6 个月	新股流通受限	11.68	26.95	510	5,956.80	13,744.50	-
688583	思看科技	2025 年 1 月 8 日	6 个月	新股流通受限	33.46	79.68	209	5,387.06	16,653.12	锁定期内发生送股

688757	胜科 纳米	2025 年 3 月 18 日	6 个月	新股流 通受限	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	-
688775	影石 创新	2025 年 6 月 4 日	6 个月	新股流 通受限	47.27	124.16	137	6,475.99	17,009.92	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有证券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金于本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失

的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在托管人和其他拥有相关资质的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

于本报告期末，除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照相关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,349,734.20	-	-	-	2,349,734.20
存出保证金	3,366.50	-	-	-	3,366.50
交易性金融资产	-	-	-	176,614,427.47	176,614,427.47
资产总计	2,353,100.70	-	-	176,614,427.47	178,967,528.17

负债					
应付管理人报酬	-	-	-	71,114.15	71,114.15
应付托管费	-	-	-	14,222.81	14,222.81
其他负债	-	-	-	86,325.08	86,325.08
负债总计	-	-	-	171,662.04	171,662.04
利率敏感度缺口	2,353,100.70	-	-	176,442,765.43	178,795,866.13
上年度末 2024 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	2,915,921.05	-	-	-	2,915,921.05
结算备付金	16,379.08	-	-	-	16,379.08
存出保证金	6,177.49	-	-	-	6,177.49
交易性金融资产	-	-	-	169,438,460.54	169,438,460.54
资产总计	2,938,477.62	-	-	169,438,460.54	172,376,938.16
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	75,255.71	75,255.71
应付托管费	-	-	-	15,051.14	15,051.14
其他负债	-	-	-	181,058.79	181,058.79
负债总计	-	-	-	271,365.64	271,365.64
利率敏感度缺口	2,938,477.62	-	-	169,167,094.90	172,105,572.52

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 2025 年 06 月 30 日，本基金未持有的交易性债券投资和资产支持证券(2024 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2024 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于标的指数成分股、备选成分股，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定

量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 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	176,614,427.47	98.78	169,438,460.54	98.45
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	176,614,427.47	98.78	169,438,460.54	98.45

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据组合的净值数据和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	+5%	8,817,361.68	8,523,381.95
	-5%	-8,817,361.68	-8,523,381.95

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	上年度末
---------------	-----	------

	2025 年 6 月 30 日	2024 年 12 月 31 日
第一层次	176,305,689.05	169,071,877.47
第二层次	14,860.10	16,641.90
第三层次	293,878.32	349,941.17
合计	176,614,427.47	169,438,460.54

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2025 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2024 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	176,614,427.47	98.69
	其中：股票	176,614,427.47	98.69
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-

6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,349,734.20	1.31
8	其他各项资产	3,366.50	0.00
9	合计	178,967,528.17	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	441,518.00	0.25
B	采矿业	6,335,078.83	3.54
C	制造业	111,636,924.42	62.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,706,227.60	3.19
E	建筑业	1,557,657.00	0.87
F	批发和零售业	3,888,245.95	2.17
G	交通运输、仓储和邮政业	2,958,460.15	1.65
H	住宿和餐饮业	474,615.60	0.27
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,446,709.20	9.20
J	金融业	17,398,517.13	9.73
K	房地产业	2,191,006.90	1.23
L	租赁和商务服务业	1,521,887.20	0.85
M	科学研究和技术服务业	1,226,598.97	0.69
N	水利、环境和公共设施管理业	742,200.04	0.42
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	364,140.00	0.20
Q	卫生和社会工作	814,216.84	0.46
R	文化、体育和娱乐业	2,489,417.64	1.39
S	综合	421,006.00	0.24
	合计	176,614,427.47	98.78

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未投资港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300476	胜宏科技	14,500	1,948,510.00	1.09
2	000988	华工科技	24,200	1,137,642.00	0.64
3	600988	赤峰黄金	40,100	997,688.00	0.56

4	300339	润和软件	19,200	975,936.00	0.55
5	002966	苏州银行	107,660	945,254.80	0.53
6	600839	四川长虹	88,900	864,108.00	0.48
7	601555	东吴证券	95,730	837,637.50	0.47
8	601162	天风证券	166,900	822,817.00	0.46
9	688521	芯原股份	8,500	820,250.00	0.46
10	002517	恺英网络	41,200	795,572.00	0.44
11	002340	格林美	123,600	784,860.00	0.44
12	002195	岩山科技	136,685	769,536.55	0.43
13	002558	巨人网络	32,600	767,730.00	0.43
14	603893	瑞芯微	5,000	759,300.00	0.42
15	002261	拓维信息	24,200	748,990.00	0.42
16	002156	通富微电	29,200	748,104.00	0.42
17	600487	亨通光电	47,600	728,280.00	0.41
18	600157	永泰能源	535,300	717,302.00	0.40
19	002797	第一创业	101,100	715,788.00	0.40
20	300251	光线传媒	35,300	715,531.00	0.40
21	300207	欣旺达	35,600	714,136.00	0.40
22	688608	恒玄科技	2,000	695,960.00	0.39
23	300803	指南针	8,600	693,676.00	0.39
24	000066	中国长城	46,700	691,160.00	0.39
25	688777	中控技术	15,300	687,123.00	0.38
26	688213	思特威	6,700	684,874.00	0.38
27	688120	华海清科	4,057	684,415.90	0.38
28	600096	云天化	30,700	674,479.00	0.38
29	600536	中国软件	14,381	672,599.37	0.38
30	002273	水晶光电	33,529	669,574.13	0.37
31	601168	西部矿业	40,166	667,960.58	0.37
32	002465	海格通信	47,800	666,332.00	0.37
33	600879	航天电子	63,600	665,892.00	0.37
34	300450	先导智能	26,400	656,040.00	0.37
35	688235	百济神州	2,800	654,192.00	0.37
36	000831	中国稀土	17,900	646,548.00	0.36
37	601099	太平洋	164,100	644,913.00	0.36
38	600352	浙江龙盛	62,700	637,032.00	0.36
39	002294	信立泰	13,400	634,222.00	0.35
40	000933	神火股份	38,000	632,320.00	0.35
41	300017	网宿科技	58,900	631,408.00	0.35
42	600885	宏发股份	28,066	626,152.46	0.35
43	002185	华天科技	61,800	624,180.00	0.35
44	601108	财通证券	78,300	619,353.00	0.35
45	688002	睿创微纳	8,767	611,235.24	0.34
46	688617	惠泰医疗	2,023	600,831.00	0.34

47	601128	常熟银行	79,849	588,487.13	0.33
48	688099	晶晨股份	8,200	582,282.00	0.33
49	002130	沃尔核材	24,300	578,826.00	0.32
50	601577	长沙银行	58,200	578,508.00	0.32
51	600079	人福医药	27,500	576,950.00	0.32
52	300454	深信服	6,100	574,498.00	0.32
53	002281	光迅科技	11,600	572,112.00	0.32
54	000423	东阿阿胶	10,900	570,070.00	0.32
55	002085	万丰奥威	35,800	568,862.00	0.32
56	002595	豪迈科技	9,600	568,512.00	0.32
57	688469	芯联集成	119,100	568,107.00	0.32
58	688122	西部超导	10,940	567,567.20	0.32
59	000997	新大陆	17,419	564,027.22	0.32
60	603129	春风动力	2,600	562,900.00	0.31
61	300223	北京君正	8,100	560,520.00	0.31
62	002738	中矿资源	17,380	558,940.80	0.31
63	300002	神州泰岳	47,300	558,140.00	0.31
64	300058	蓝色光标	85,020	557,731.20	0.31
65	002532	天山铝业	67,100	557,601.00	0.31
66	300474	景嘉微	7,600	554,800.00	0.31
67	000783	长江证券	80,000	554,400.00	0.31
68	300458	全志科技	13,900	551,691.00	0.31
69	600109	国金证券	62,600	549,002.00	0.31
70	002472	双环传动	16,300	545,887.00	0.31
71	002138	顺络电子	19,400	545,528.00	0.31
72	002078	太阳纸业	40,400	543,784.00	0.30
73	002436	兴森科技	40,700	538,868.00	0.30
74	603596	伯特利	10,200	537,438.00	0.30
75	601933	永辉超市	109,100	534,590.00	0.30
76	002410	广联达	39,800	533,718.00	0.30
77	300346	南大光电	16,700	528,388.00	0.30
78	002851	麦格米特	10,500	526,470.00	0.29
79	600862	中航高科	20,100	524,208.00	0.29
80	600143	金发科技	50,800	523,748.00	0.29
81	688072	拓荆科技	3,400	522,614.00	0.29
82	300765	新诺威	10,100	522,069.00	0.29
83	300136	信维通信	23,300	521,920.00	0.29
84	601198	东兴证券	46,800	521,820.00	0.29
85	002850	科达利	4,600	520,582.00	0.29
86	600580	卧龙电驱	26,280	519,555.60	0.29
87	300054	鼎龙股份	18,100	519,108.00	0.29
88	688525	佰维存储	7,700	518,980.00	0.29
89	300024	机器人	30,200	518,836.00	0.29

90	002065	东华软件	54,000	518,400.00	0.29
91	002353	杰瑞股份	14,800	518,000.00	0.29
92	002223	鱼跃医疗	14,550	517,980.00	0.29
93	000034	神州数码	13,700	515,668.00	0.29
94	600873	梅花生物	48,100	514,189.00	0.29
95	600298	安琪酵母	14,600	513,482.00	0.29
96	603606	东方电缆	9,900	511,929.00	0.29
97	688578	艾力斯	5,500	511,720.00	0.29
98	002202	金风科技	49,900	511,475.00	0.29
99	300395	菲利华	10,000	511,000.00	0.29
100	300496	中科创达	8,900	509,258.00	0.28
101	002673	西部证券	64,500	508,260.00	0.28
102	600363	联创光电	8,700	507,471.00	0.28
103	601615	明阳智能	43,800	503,262.00	0.28
104	300857	协创数据	5,800	499,148.00	0.28
105	000728	国元证券	63,100	497,859.00	0.28
106	300383	光环新网	34,700	496,210.00	0.28
107	002624	完美世界	32,700	496,059.00	0.28
108	000021	深科技	26,300	492,862.00	0.28
109	002008	大族激光	20,200	492,274.00	0.28
110	300115	长盈精密	22,800	487,920.00	0.27
111	603659	璞泰来	25,700	482,646.00	0.27
112	600549	厦门钨业	23,000	481,160.00	0.27
113	600895	张江高科	18,600	478,020.00	0.27
114	688220	翱捷科技	6,100	477,630.00	0.27
115	603087	甘李药业	8,700	476,586.00	0.27
116	300604	长川科技	10,600	476,046.00	0.27
117	603160	汇顶科技	6,700	475,901.00	0.27
118	000426	兴业银锡	30,000	474,000.00	0.27
119	300012	华测检测	40,500	473,445.00	0.26
120	603605	珀莱雅	5,700	471,903.00	0.26
121	002155	湖南黄金	26,365	470,615.25	0.26
122	000733	振华科技	9,400	470,470.00	0.26
123	600171	上海贝岭	13,700	469,225.00	0.26
124	300627	华测导航	13,160	460,600.00	0.26
125	605589	圣泉集团	16,300	452,325.00	0.25
126	688361	中科飞测	5,349	450,332.31	0.25
127	601216	君正集团	81,400	449,328.00	0.25
128	300699	光威复材	14,080	445,913.60	0.25
129	601665	齐鲁银行	70,300	444,296.00	0.25
130	600392	盛和资源	33,695	443,763.15	0.25
131	300037	新宙邦	12,600	443,520.00	0.25
132	000750	国海证券	107,520	442,982.40	0.25

133	601997	贵阳银行	70,500	439,920.00	0.25
134	000932	华菱钢铁	99,980	439,912.00	0.25
135	000519	中兵红箭	20,062	439,157.18	0.25
136	002444	巨星科技	17,200	438,772.00	0.25
137	688180	君实生物	12,900	438,342.00	0.25
138	000729	燕京啤酒	33,900	438,327.00	0.25
139	300003	乐普医疗	31,800	438,204.00	0.25
140	600153	建发股份	41,900	434,503.00	0.24
141	600060	海信视像	18,800	432,776.00	0.24
142	601717	中创智领	26,000	432,120.00	0.24
143	300073	当升科技	9,800	429,926.00	0.24
144	601990	南京证券	53,200	429,856.00	0.24
145	601696	中银证券	40,200	429,738.00	0.24
146	601233	桐昆股份	40,500	429,300.00	0.24
147	000878	云南铜业	33,700	428,664.00	0.24
148	300001	特锐德	17,800	426,666.00	0.24
149	002821	凯莱英	4,800	423,600.00	0.24
150	300142	沃森生物	38,500	423,500.00	0.24
151	002414	高德红外	41,200	422,300.00	0.24
152	600673	东阳光	36,200	421,006.00	0.24
153	688052	纳芯微	2,400	418,776.00	0.23
154	603979	金诚信	9,000	417,960.00	0.23
155	600369	西南证券	96,000	417,600.00	0.23
156	002837	英维克	14,000	415,940.00	0.23
157	600699	均胜电子	23,760	414,374.40	0.23
158	002007	华兰生物	26,400	413,688.00	0.23
159	300373	扬杰科技	7,900	410,010.00	0.23
160	688065	凯赛生物	8,700	409,770.00	0.23
161	600521	华海药业	21,800	406,134.00	0.23
162	600177	雅戈尔	55,600	405,880.00	0.23
163	600118	中国卫星	14,200	405,694.00	0.23
164	000893	亚钾国际	13,400	403,876.00	0.23
165	002152	广电运通	30,000	403,200.00	0.23
166	600398	海澜之家	57,900	402,984.00	0.23
167	600435	北方导航	25,500	397,545.00	0.22
168	600704	物产中大	75,200	396,304.00	0.22
169	300748	金力永磁	16,540	394,313.60	0.22
170	000738	航发控制	19,000	394,250.00	0.22
171	603345	安井食品	4,900	394,058.00	0.22
172	600909	华安证券	67,490	393,466.70	0.22
173	000623	吉林敖东	23,100	391,545.00	0.22
174	600497	驰宏锌锗	73,600	389,344.00	0.22
175	688249	晶合集成	19,200	389,184.00	0.22

176	600316	洪都航空	10,300	388,310.00	0.22
177	002044	美年健康	75,400	387,556.00	0.22
178	002318	久立特材	16,500	385,935.00	0.22
179	002958	青农商行	106,900	385,909.00	0.22
180	000009	中国宝安	43,380	385,214.40	0.22
181	603179	新泉股份	8,200	385,154.00	0.22
182	688027	国盾量子	1,400	385,014.00	0.22
183	600765	中航重机	22,780	384,526.40	0.22
184	600038	中直股份	9,869	383,015.89	0.21
185	600141	兴发集团	18,580	381,447.40	0.21
186	688385	复旦微电	7,700	379,379.00	0.21
187	002409	雅克科技	6,900	377,361.00	0.21
188	603228	景旺电子	8,968	375,221.12	0.21
189	600562	国睿科技	11,900	374,731.00	0.21
190	000400	许继电气	17,200	374,444.00	0.21
191	002683	广东宏大	11,000	373,340.00	0.21
192	600155	华创云信	53,600	373,056.00	0.21
193	000528	柳工	38,800	372,868.00	0.21
194	300919	中伟股份	11,300	371,544.00	0.21
195	001696	宗申动力	16,500	370,425.00	0.21
196	002607	中公教育	119,000	364,140.00	0.20
197	300724	捷佳伟创	6,700	363,810.00	0.20
198	000960	锡业股份	23,700	362,610.00	0.20
199	600637	东方明珠	48,500	362,295.00	0.20
200	600563	法拉电子	3,300	359,997.00	0.20
201	300757	罗博特科	2,400	359,928.00	0.20
202	600498	烽火通信	17,100	359,613.00	0.20
203	600884	杉杉股份	37,900	358,534.00	0.20
204	603939	益丰药房	14,624	357,849.28	0.20
205	300623	捷捷微电	12,000	357,600.00	0.20
206	688188	柏楚电子	2,701	355,613.66	0.20
207	600529	山东药玻	16,000	354,240.00	0.20
208	300558	贝达药业	6,100	353,495.00	0.20
209	002841	视源股份	10,100	349,460.00	0.20
210	688568	中科星图	9,700	349,297.00	0.20
211	000039	中集集团	44,433	349,243.38	0.20
212	002739	万达电影	30,500	348,615.00	0.19
213	000415	渤海租赁	104,100	346,653.00	0.19
214	002653	海思科	8,100	341,982.00	0.19
215	301358	湖南裕能	10,900	339,971.00	0.19
216	002926	华西证券	38,000	339,720.00	0.19
217	600486	扬农化工	5,856	339,648.00	0.19
218	002025	航天电器	6,600	339,306.00	0.19

219	600901	江苏金租	55,700	337,542.00	0.19
220	688017	绿的谐波	2,700	337,203.00	0.19
221	002385	大北农	83,000	335,320.00	0.19
222	000887	中鼎股份	19,000	334,210.00	0.19
223	300285	国瓷材料	19,200	333,120.00	0.19
224	300763	锦浪科技	5,800	332,862.00	0.19
225	688114	华大智造	5,100	330,633.00	0.18
226	603486	科沃斯	5,600	326,088.00	0.18
227	002939	长城证券	38,900	325,982.00	0.18
228	002568	百润股份	12,700	325,247.00	0.18
229	600820	隧道股份	53,000	323,300.00	0.18
230	300144	宋城演艺	37,800	323,190.00	0.18
231	688582	芯动联科	4,800	322,560.00	0.18
232	600863	内蒙华电	78,400	322,224.00	0.18
233	300679	电连技术	7,100	322,198.00	0.18
234	000723	美锦能源	74,300	320,976.00	0.18
235	600132	重庆啤酒	5,800	319,580.00	0.18
236	600008	首创环保	105,820	319,576.40	0.18
237	002064	华峰化学	47,900	316,619.00	0.18
238	002080	中材科技	16,200	315,900.00	0.18
239	000513	丽珠集团	8,753	315,458.12	0.18
240	600390	五矿资本	54,100	315,403.00	0.18
241	600516	方大炭素	67,700	314,128.00	0.18
242	603568	伟明环保	16,383	312,587.64	0.17
243	688183	生益电子	6,100	312,320.00	0.17
244	002312	川发龙蟒	27,200	312,256.00	0.17
245	600998	九州通	60,548	311,216.72	0.17
246	000703	恒逸石化	52,900	311,052.00	0.17
247	688538	和辉光电	132,900	310,986.00	0.17
248	600166	福田汽车	114,400	310,024.00	0.17
249	600763	通策医疗	7,503	309,723.84	0.17
250	600170	上海建工	128,600	307,354.00	0.17
251	300487	蓝晓科技	6,100	306,830.00	0.17
252	002262	恩华药业	14,700	305,466.00	0.17
253	603816	顾家家居	11,900	303,688.00	0.17
254	002500	山西证券	51,990	303,621.60	0.17
255	600208	衢州发展	102,500	303,400.00	0.17
256	603589	口子窖	8,700	302,760.00	0.17
257	601179	中国西电	49,300	302,702.00	0.17
258	600312	平高电气	19,600	301,644.00	0.17
259	605358	立昂微	12,900	300,570.00	0.17
260	000683	博源化工	62,500	299,375.00	0.17
261	300676	华大基因	6,000	298,620.00	0.17

262	002203	海亮股份	28,900	298,248.00	0.17
263	601155	新城控股	21,800	298,224.00	0.17
264	600021	上海电力	33,900	297,981.00	0.17
265	600985	淮北矿业	25,900	293,706.00	0.16
266	600126	杭钢股份	32,530	292,770.00	0.16
267	002244	滨江集团	30,000	292,500.00	0.16
268	600380	健康元	26,496	292,250.88	0.16
269	600583	海油工程	53,400	291,564.00	0.16
270	002432	九安医疗	8,000	291,440.00	0.16
271	000403	派林生物	16,050	290,986.50	0.16
272	000591	太阳能	66,000	289,740.00	0.16
273	601000	唐山港	71,346	289,664.76	0.16
274	603338	浙江鼎力	6,100	289,140.00	0.16
275	600348	华阳股份	43,350	288,711.00	0.16
276	000060	中金岭南	62,900	288,082.00	0.16
277	688728	格科微	18,700	287,980.00	0.16
278	000629	钒钛股份	111,900	286,464.00	0.16
279	603885	吉祥航空	21,200	285,564.00	0.16
280	000921	海信家电	11,100	285,270.00	0.16
281	600872	中炬高新	15,000	285,000.00	0.16
282	300567	精测电子	4,700	284,867.00	0.16
283	000830	鲁西化工	27,600	284,280.00	0.16
284	601991	大唐发电	89,600	284,032.00	0.16
285	002603	以岭药业	20,100	283,410.00	0.16
286	600535	天士力	18,000	281,700.00	0.16
287	002984	森麒麟	15,000	281,250.00	0.16
288	603379	三美股份	5,840	281,020.80	0.16
289	600816	建元信托	95,000	280,250.00	0.16
290	002439	启明星辰	17,500	279,825.00	0.16
291	688278	特宝生物	3,864	278,633.04	0.16
292	002056	横店东磁	19,600	277,340.00	0.16
293	300146	汤臣倍健	24,600	276,504.00	0.15
294	600095	湘财股份	27,500	275,825.00	0.15
295	600970	中材国际	31,800	272,844.00	0.15
296	002423	中粮资本	22,200	271,506.00	0.15
297	600499	科达制造	27,700	271,460.00	0.15
298	000062	深圳华强	10,100	271,286.00	0.15
299	603927	中科软	14,020	271,146.80	0.15
300	601016	节能风电	93,740	270,908.60	0.15
301	601880	辽港股份	180,140	270,210.00	0.15
302	600685	中船防务	9,900	269,181.00	0.15
303	603000	人民网	13,300	268,793.00	0.15
304	000636	风华高科	19,500	267,930.00	0.15

305	601611	中国核建	29,000	266,510.00	0.15
306	000958	电投产融	38,900	266,076.00	0.15
307	603298	杭叉集团	12,700	266,065.00	0.15
308	300390	天华新能	13,940	265,835.80	0.15
309	600511	国药股份	9,100	265,356.00	0.15
310	601666	平煤股份	35,800	265,278.00	0.15
311	300212	易华录	12,140	264,166.40	0.15
312	603737	三棵树	7,156	263,698.60	0.15
313	000563	陕国投 A	73,600	262,752.00	0.15
314	301308	江波龙	3,000	262,470.00	0.15
315	000155	川能动力	26,700	262,194.00	0.15
316	600859	王府井	18,875	262,173.75	0.15
317	600655	豫园股份	47,100	261,405.00	0.15
318	601456	国联民生	25,200	260,820.00	0.15
319	600004	白云机场	28,600	260,260.00	0.15
320	603077	和邦生物	148,560	259,980.00	0.15
321	601966	玲珑轮胎	17,700	259,659.00	0.15
322	600325	华发股份	53,170	258,937.90	0.14
323	000598	兴蓉环境	35,900	258,839.00	0.14
324	300677	英科医疗	10,920	258,585.60	0.14
325	603899	晨光股份	8,900	258,011.00	0.14
326	002773	康弘药业	8,900	257,833.00	0.14
327	600483	福能股份	26,700	257,388.00	0.14
328	688297	中无人机	4,800	256,320.00	0.14
329	603156	养元饮品	12,100	256,036.00	0.14
330	601958	金钼股份	23,400	255,996.00	0.14
331	688301	奕瑞科技	2,912	255,120.32	0.14
332	600131	国网信通	14,400	254,880.00	0.14
333	600378	昊华科技	9,300	251,751.00	0.14
334	600663	陆家嘴	28,400	251,624.00	0.14
335	688520	神州细胞	4,200	251,370.00	0.14
336	000050	深天马 A	29,500	251,340.00	0.14
337	600282	南钢股份	59,400	249,480.00	0.14
338	000987	越秀资本	36,330	249,223.80	0.14
339	002507	涪陵榨菜	19,430	248,509.70	0.14
340	300529	健帆生物	11,500	248,055.00	0.14
341	000951	中国重汽	14,100	247,878.00	0.14
342	002756	永兴材料	7,800	247,650.00	0.14
343	600271	航天信息	26,800	247,632.00	0.14
344	301536	星宸科技	4,100	247,230.00	0.14
345	600754	锦江酒店	11,000	246,840.00	0.14
346	600598	北大荒	17,100	246,582.00	0.14
347	300601	康泰生物	16,200	246,078.00	0.14

348	688234	天岳先进	4,198	245,792.90	0.14
349	601001	晋控煤业	20,100	245,622.00	0.14
350	600737	中粮糖业	25,800	243,810.00	0.14
351	000559	万向钱潮	31,700	242,505.00	0.14
352	600739	辽宁成大	22,000	242,000.00	0.14
353	601918	新集能源	37,400	241,604.00	0.14
354	002429	兆驰股份	54,700	239,586.00	0.13
355	600582	天地科技	39,900	239,001.00	0.13
356	300751	迈为股份	3,400	236,504.00	0.13
357	601333	广深铁路	81,800	236,402.00	0.13
358	300070	碧水源	52,500	236,250.00	0.13
359	688363	华熙生物	4,600	236,210.00	0.13
360	603290	斯达半导	2,900	235,683.00	0.13
361	601866	中远海发	94,900	234,403.00	0.13
362	688772	珠海冠宇	16,400	234,356.00	0.13
363	600566	济川药业	8,900	234,337.00	0.13
364	002120	韵达股份	34,900	233,830.00	0.13
365	300735	光弘科技	9,300	233,430.00	0.13
366	601231	环旭电子	15,900	232,617.00	0.13
367	600867	通化东宝	28,200	231,240.00	0.13
368	600764	中国海防	6,800	231,200.00	0.13
369	003031	中瓷电子	4,340	230,931.40	0.13
370	603688	石英股份	6,550	230,691.00	0.13
371	603728	鸣志电器	4,000	229,880.00	0.13
372	300888	稳健医疗	5,580	229,338.00	0.13
373	002430	杭氧股份	11,800	229,156.00	0.13
374	600258	首旅酒店	16,120	227,775.60	0.13
375	603341	龙旗科技	5,600	227,528.00	0.13
376	601098	中南传媒	17,300	226,976.00	0.13
377	600995	南网储能	23,200	226,896.00	0.13
378	600329	达仁堂	6,800	226,848.00	0.13
379	688561	奇安信	6,600	224,268.00	0.13
380	688676	金盘科技	6,700	224,115.00	0.13
381	688778	厦钨新能	3,990	223,120.80	0.12
382	600707	彩虹股份	34,500	222,870.00	0.12
383	601212	白银有色	71,200	222,856.00	0.12
384	000032	深桑达 A	11,000	222,530.00	0.12
385	000027	深圳能源	34,220	218,323.60	0.12
386	600578	京能电力	48,200	216,418.00	0.12
387	603858	步长制药	13,300	215,992.00	0.12
388	300573	兴齐眼药	4,160	215,446.40	0.12
389	000709	河钢股份	99,700	215,352.00	0.12
390	002508	老板电器	11,300	214,813.00	0.12

391	002299	圣农发展	15,000	214,350.00	0.12
392	603529	爱玛科技	6,200	213,280.00	0.12
393	600906	财达证券	31,200	212,784.00	0.12
394	000967	盈峰环境	30,500	211,975.00	0.12
395	000883	湖北能源	47,000	211,970.00	0.12
396	600517	国网英大	41,300	210,630.00	0.12
397	002670	国盛金控	13,936	209,736.80	0.12
398	600848	上海临港	23,100	209,517.00	0.12
399	601399	国机重装	69,700	209,100.00	0.12
400	002831	裕同科技	8,920	208,906.40	0.12
401	600546	山煤国际	23,900	208,647.00	0.12
402	301498	乖宝宠物	1,900	207,803.00	0.12
403	600959	江苏有线	60,400	207,776.00	0.12
404	688318	财富趋势	1,800	206,856.00	0.12
405	601928	凤凰传媒	18,400	205,528.00	0.11
406	601156	东航物流	15,300	200,277.00	0.11
407	600968	海油发展	48,800	199,104.00	0.11
408	600808	马钢股份	57,636	198,844.20	0.11
409	300595	欧普康视	13,000	198,510.00	0.11
410	600528	中铁工业	26,747	197,392.86	0.11
411	000825	太钢不锈	54,700	196,373.00	0.11
412	002572	索菲亚	14,000	196,140.00	0.11
413	000739	普洛药业	14,000	196,000.00	0.11
414	603225	新凤鸣	18,340	195,321.00	0.11
415	301301	川宁生物	16,200	195,048.00	0.11
416	601118	海南橡胶	41,300	194,936.00	0.11
417	600977	中国电影	18,087	193,892.64	0.11
418	603565	中谷物流	20,300	193,865.00	0.11
419	601636	旗滨集团	38,600	193,386.00	0.11
420	002266	浙富控股	62,780	193,362.40	0.11
421	600801	华新水泥	16,272	192,660.48	0.11
422	601608	中信重工	44,000	192,280.00	0.11
423	600871	石化油服	98,300	191,685.00	0.11
424	000543	皖能电力	27,300	191,100.00	0.11
425	601598	中国外运	38,000	187,340.00	0.10
426	600062	华润双鹤	10,032	187,197.12	0.10
427	688563	航材股份	3,300	186,879.00	0.10
428	600056	中国医药	18,060	186,740.40	0.10
429	603650	彤程新材	5,800	186,470.00	0.10
430	688387	信科移动	32,900	185,885.00	0.10
431	000582	北部湾港	22,500	185,625.00	0.10
432	601106	中国一重	66,000	184,800.00	0.10
433	000785	居然智家	60,000	183,000.00	0.10

434	300957	贝泰妮	4,100	181,302.00	0.10
435	603233	大参林	10,956	178,582.80	0.10
436	688702	盛科通信	2,900	177,132.00	0.10
437	600925	苏能股份	33,100	173,113.00	0.10
438	600373	中文传媒	16,800	172,536.00	0.10
439	601965	中国汽研	9,700	172,175.00	0.10
440	002153	石基信息	19,820	171,641.20	0.10
441	000429	粤高速 A	12,600	167,958.00	0.09
442	000537	中绿电	19,900	166,364.00	0.09
443	600606	绿地控股	101,300	165,119.00	0.09
444	688281	华秦科技	2,716	164,345.16	0.09
445	601568	北元集团	38,270	158,820.50	0.09
446	002372	伟星新材	15,300	158,508.00	0.09
447	688425	铁建重工	38,800	158,304.00	0.09
448	600361	创新新材	39,600	158,004.00	0.09
449	600098	广州发展	25,200	157,500.00	0.09
450	001286	陕西能源	18,000	156,600.00	0.09
451	600612	老凤祥	3,100	154,225.00	0.09
452	603658	安图生物	4,100	153,750.00	0.09
453	003022	联泓新科	9,600	151,968.00	0.08
454	600688	上海石化	53,000	151,050.00	0.08
455	688349	三一重能	5,900	147,146.00	0.08
456	000937	冀中能源	25,400	146,050.00	0.08
457	301165	锐捷网络	2,340	143,816.40	0.08
458	601019	山东出版	15,100	142,997.00	0.08
459	000898	鞍钢股份	57,600	133,632.00	0.07
460	002608	江苏国信	18,100	132,673.00	0.07
461	600339	中油工程	40,500	132,435.00	0.07
462	600032	浙江新能	17,500	132,300.00	0.07
463	601139	深圳燃气	20,700	131,652.00	0.07
464	688100	威胜信息	3,500	129,675.00	0.07
465	603707	健友股份	11,626	129,629.90	0.07
466	688248	南网科技	4,100	128,986.00	0.07
467	600720	中交设计	16,600	128,318.00	0.07
468	000959	首钢股份	37,700	128,180.00	0.07
469	600928	西安银行	32,100	125,832.00	0.07
470	003035	南网能源	27,300	125,307.00	0.07
471	688032	禾迈股份	1,239	123,726.54	0.07
472	600295	鄂尔多斯	14,200	123,682.00	0.07
473	603556	海兴电力	4,700	119,709.00	0.07
474	002461	珠江啤酒	10,600	119,674.00	0.07
475	601228	广州港	36,600	118,218.00	0.07
476	301267	华夏眼科	6,100	116,937.00	0.07

477	688475	萤石网络	3,700	116,624.00	0.07
478	688172	燕东微	5,700	112,062.00	0.06
479	688375	国博电子	1,839	110,358.39	0.06
480	603786	科博达	1,900	105,279.00	0.06
481	600927	永安期货	7,000	103,670.00	0.06
482	601061	中信金属	13,000	102,830.00	0.06
483	002563	森马服饰	19,500	102,570.00	0.06
484	600007	中国国贸	4,800	98,784.00	0.06
485	000539	粤电力 A	21,300	96,702.00	0.05
486	600299	安迪苏	9,800	94,570.00	0.05
487	002945	华林证券	6,500	93,405.00	0.05
488	603826	坤彩科技	4,760	93,153.20	0.05
489	688819	天能股份	3,300	91,608.00	0.05
490	300140	节能环保	14,800	91,316.00	0.05
491	001213	中铁特货	21,300	86,478.00	0.05
492	601921	浙版传媒	10,700	86,242.00	0.05
493	601858	中国科传	3,800	73,910.00	0.04
494	601158	重庆水务	13,700	63,568.00	0.04
495	688153	唯捷创芯	2,000	62,020.00	0.03
496	001389	广合科技	1,000	58,770.00	0.03
497	600956	新天绿能	7,500	57,900.00	0.03
498	688295	中复神鹰	2,419	50,315.20	0.03
499	603868	飞科电器	1,100	39,457.00	0.02
500	688411	海博思创	314	26,215.86	0.01
501	301458	钧崴电子	512	17,464.32	0.01
502	688775	影石创新	137	17,009.92	0.01
503	688583	思看科技	209	16,653.12	0.01
504	301602	超研股份	658	16,318.40	0.01
505	001388	信通电子	905	14,860.10	0.01
506	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.01
507	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.01
508	688545	兴福电子	510	13,744.50	0.01
509	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.01
510	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.01
511	301678	新恒汇	250	11,135.00	0.01
512	301479	弘景光电	132	10,278.84	0.01
513	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
514	301658	首航新能	376	8,640.48	0.00
515	301275	汉朔科技	150	8,428.50	0.00
516	001391	国货航	1,243	8,365.39	0.00
517	603072	天和磁材	136	7,405.20	0.00
518	001382	新亚电缆	350	7,073.50	0.00
519	301501	恒鑫生活	145	6,556.90	0.00

520	001356	富岭股份	427	6,165.88	0.00
521	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
522	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
523	301636	泽润新能	109	5,173.14	0.00
524	301590	优优绿能	37	5,160.76	0.00
525	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
526	603210	泰鸿万立	250	3,902.50	0.00
527	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
528	603049	中策橡胶	75	3,213.75	0.00
529	603014	威高血净	90	2,941.20	0.00
530	603271	永杰新材	76	2,666.08	0.00
531	001390	古麒绒材	144	2,609.28	0.00
532	603257	中国瑞林	69	2,585.43	0.00
533	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
534	603202	天有为	27	2,447.82	0.00
535	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
536	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
537	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00
538	603409	汇通控股	61	2,032.52	0.00
539	400174	中天 3	138,400	0.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688608	恒玄科技	758,621.66	0.44
2	688235	百济神州	716,626.00	0.42
3	000933	神火股份	641,327.00	0.37
4	300450	先导智能	586,129.00	0.34
5	002130	沃尔核材	548,871.00	0.32
6	300454	深信服	543,823.00	0.32
7	300458	全志科技	540,413.00	0.31
8	600363	联创光电	522,451.00	0.30
9	300346	南大光电	502,376.00	0.29
10	002851	麦格米特	485,468.00	0.28
11	300857	协创数据	477,083.00	0.28
12	300115	长盈精密	476,687.00	0.28
13	600171	上海贝岭	440,401.00	0.26
14	605589	圣泉集团	437,336.00	0.25
15	603659	璞泰来	431,273.00	0.25
16	002007	华兰生物	429,755.00	0.25
17	300627	华测导航	416,280.00	0.24

18	688027	国盾量子	381,492.00	0.22
19	002837	英维克	378,055.00	0.22
20	000528	柳工	377,709.00	0.22

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

7.4.2 累计卖出金额超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	600418	江淮汽车	1,811,577.00	1.05
2	002625	光启技术	1,433,808.00	0.83
3	002384	东山精密	1,056,963.00	0.61
4	301236	软通动力	746,503.00	0.43
5	302132	中航成飞	624,501.00	0.36
6	300866	安克创新	584,358.00	0.34
7	002128	电投能源	529,466.40	0.31
8	688047	龙芯中科	476,058.88	0.28
9	600642	申能股份	414,918.00	0.24
10	601567	三星医疗	385,483.00	0.22
11	002407	多氟多	341,591.60	0.20
12	688536	思瑞浦	330,093.41	0.19
13	603444	吉比特	308,920.00	0.18
14	000818	航锦科技	291,703.00	0.17
15	002487	大金重工	284,488.00	0.17
16	688331	荣昌生物	279,399.96	0.16
17	002019	亿帆医药	264,193.00	0.15
18	600416	湘电股份	260,962.00	0.15
19	300009	安科生物	258,633.44	0.15
20	000998	隆平高科	258,549.00	0.15

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	23,449,146.79
卖出股票收入（成交）总额	23,283,523.09

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，胜宏科技(惠州)股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方海关的处罚；赤峰吉隆黄金矿业股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到证监会分局的处罚；苏州银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方市场监督管理局、国家金融监督管理总局地方监管分局、国家金融监督管理总局地方监管局的处罚；东吴证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到北京证券交易所、地方市场监督管理局、证监会的处罚；天风证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到人社局、证监会分局的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,366.50
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	3,366.50

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限制的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金 份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
301	419,663.41	124,612,338.00	98.65	1,706,349.00	1.35

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

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	中信证券股份有限公司	1,723,752.00	1.36
2	姜晓平	235,683.00	0.19
3	王海利	200,000.00	0.16
4	张红艳	197,700.00	0.16
5	陈妙琴	139,373.00	0.11
6	余丽丽	74,100.00	0.06
7	李淑清	69,455.00	0.05
8	刘秀珍	46,303.00	0.04
9	钮冰融	46,303.00	0.04
10	黄子祺	46,200.00	0.04
11	中国农业银行股份有限公司—国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	122,886,786.00	97.28

注：表中前十名持有人为除国寿安保中证 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

本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 5 月 29 日）基金份额总额	665,869,631.00
本报告期期初基金份额总额	128,318,687.00
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	126,318,687.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。

2025 年 2 月，中国农业银行总行决定陈振华任托管业务部副总裁。

2025 年 3 月，中国农业银行总行决定常佳任托管业务部副总裁。

2025 年 4 月，中国农业银行总行决定李亚红任托管业务部高级专家。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及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

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
中信证券	2	44,176,556.01	96.95	8,653.77	96.95	—
中金公司	2	1,390,821.00	3.05	272.37	3.05	—
长城证券	2	—	—	—	—	—
国泰海通	4	—	—	—	—	—
国信证券	2	—	—	—	—	—
申万宏源	1	—	—	—	—	—

太平洋证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-

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

- 1、关于基金专用交易单元的选择标准：
- (1) 综合实力较强，市场信誉良好；

(2) 财务状况良好、经营状况稳健；

(3) 经营行为规范，合规风险控制能力较强，具备健全的内部控制制度，建立相关业务利益冲突防范机制，完善隔离墙制度，确保研究服务客观公正；

(4) 研究实力较强，拥有独立的研究部门，研究范围覆盖宏观经济、金融市场和相关行业研究。并能够第一时间提供丰富的高质量研究咨询报告，并能根据特定要求提供定制研究报告；能够积极同我公司进行业务交流，定期来我公司进行观点交流和路演；

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

(6) 从制度上和技术上保证我公司租用交易单元的交易信息严格保密。
- 2、关于基金专用交易单元的选择程序：
- (1) 公司相关业务部门提出新增交易单元的需求，研究部根据公司《证券公司交易单元管理办法》的选择标准提出备选证券公司名单；

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

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

10.7.2 基金租用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	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

		例 (%)				比例 (%)
中信证券	84,875.17	100.00	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

无。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
其他	1	20250101~20250630	125,137,586.00	0.00	2,250,800.00	122,886,786.00	97.28
产品特有风险							
本基金在报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情形，可能存在大额赎回的风险，并导致基金净值波动。此外，机构投资者赎回后，可能导致基金规模大幅减小，不利于基金的正常运作。							
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，并将采取有效措施保证中小投资者的合法权益。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

自 2025 年 3 月 21 日起，本基金指数使用费由基金管理人承担。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

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

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

12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照

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

12.1.6 中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

12.3.1 营业时间内到本公司免费查阅

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

12.3.3 拨打本公司客户服务电话垂询: 4009-258-258

国寿安保基金管理有限公司

2025 年 8 月 30 日