

国联中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:国联基金管理有限公司

基金托管人:中国光大银行股份有限公司

送出日期:2024 年 08 月 30 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年8月23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2024年01月01日起至2024年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告.....	41
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	61
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	61
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	61
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	61
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	61
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
7.12 投资组合报告附注	62
§8 基金份额持有人信息.....	63
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	63
8.2 期末上市基金前十名持有人	63

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	64
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.....	64
§9 开放式基金份额变动.....	64
§10 重大事件揭示.....	64
10.1 基金份额持有人大会决议.....	64
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.....	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	65
10.4 基金投资策略的改变.....	65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	65
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.....	65
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	65
10.8 其他重大事件.....	66
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	67
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.....	67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	67
§12 备查文件目录.....	67
12.1 备查文件目录.....	67
12.2 存放地点.....	67
12.3 查阅方式.....	67

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国联中证500交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	国联中证500ETF
场内简称	国联500（基金扩位简称：国联中证500ETF）
基金主代码	515550
基金运作方式	交易型开放式（ETF）
基金合同生效日	2019年11月15日
基金管理人	国联基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	29,345,700.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2019年12月25日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况（如流动性不足、成份股长期停牌、法律法规限制等）导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	中证500指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国联基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	曹健	石立平
	联系电话	010-56517000	010-63639180
	电子邮箱	caojian@gfund.com	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		400-160-6000; 010-56517299	95595
传真		010-56517001	010-63639132
注册地址		深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路3086号大百汇广场31层02-04单元	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
办公地址		北京市东城区安定门外大街208号玖安广场A座11层	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码		100011	100033
法定代表人		王瑶	吴利军

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

会计师事务所	上会会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市静安区威海路755号文新报业大厦25楼
--------	------------------	------------------------

§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 (2024年01月01日- 2024年06月30日)
本期已实现收益	-653,760.01
本期利润	-2,362,368.72
加权平均基金份额本期利润	-0.0853
本期加权平均净值利润率	-7.48%
本期基金份额净值增长率	-7.41%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)
期末可供分配利润	2,540,616.37
期末可供分配基金份额利润	0.0866
期末基金资产净值	31,886,316.37
期末基金份额净值	1.0866
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024年06月30日)
基金份额累计净值增长率	8.66%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 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	-6.11%	0.95%	-6.89%	0.96%	0.78%	-0.01%
过去三个月	-5.19%	1.11%	-6.50%	1.14%	1.31%	-0.03%
过去六个月	-7.41%	1.54%	-8.96%	1.61%	1.55%	-0.07%
过去一年	-15.83%	1.22%	-17.60%	1.27%	1.77%	-0.05%
过去三年	-22.31%	1.15%	-27.40%	1.20%	5.09%	-0.05%
自基金合同 生效起至今	8.66%	1.21%	0.62%	1.27%	8.04%	-0.06%

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

国联中证500ETF累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2019年11月15日-2024年06月30日)



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

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为国联基金管理有限公司，成立于2013年5月31日，由国联证券股份有限公司与上海融晟投资有限公司共同出资，注册资金7.5亿元人民币。截至2024年6月30日，国联基金管理有限公司共管理87只基金，包括国联货币市场基金、国联国企改革灵活配置混合型证券投资基金、国联新机遇灵活配置混合型证券投资基金、国联鑫起点灵活配置混合型证券投资基金、国联国证钢铁行业指数型证券投资基金、国联中证煤炭指数型证券投资基金、国联新经济灵活配置混合型证券投资基金、国联日日盈交易型货币市场基金、国联产业升级灵活配置混合型证券投资基金、国联竞争优势股票型证券投资基金、国联现金增利货币市场基金、国联上海清算所银行间1-3年中高等级信用债指数发起式证券投资基金、国联恒泰纯债债券型证券投资基金、国联鑫思路灵活配置混合型证券投资基金、国联物联网主题灵活配置混合型证券投资基金、国联盈泽中短债债券型证券投资基金、国联恒信纯债债券型证券投资基金、国联睿祥纯债债券型证券投资基金、国联核心成长灵活配置混合型证券投资基金、国联沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金、国联鑫价值灵活配置混合型证券投资基金、国联聚商3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联季季红定期开放债券型证券投资基金、国联智选红利股票型证券投资基金、国联聚安3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联医疗健康精选混合型证券投资基金、国联聚业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联恒裕纯债债券型证券投资基金、国联聚明3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联恒惠纯债债券型证券投资基金、国联央视财经50交易型开放式指数证券投资基金、国联央视财经50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国联策略优选混合型证券投资基金、国联聚汇3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联恒鑫纯债债券型证券投资基金、国联高股息精选混合型证券投资基金、国联睿享86个月定期开放债券型证券投资基金、国联中证500交易型开放式指数证券投资基金、国联聚通3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联睿嘉39个月定期开放债券型证券投资基金、国联中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国联恒安纯债债券型证券投资基金、国联智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、国联品牌优选混合型证券投资基金、国联中债1-5年国开行债券指数证券投资基金、国联聚锦一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国联融慧双欣一年定期开放债券型证券投资基金、国联价值成长6个月持有期混合型证券投资基金、国联创业板两年定期开放混合型证券投资基金、国联成长优选混合型证券投资基金、国联景瑞一年持有期混合型证券投资基金、国联景颐6个月持有期混合型证券投资基金、国联行业先锋6个月持有期混合型证券投资基金、国联鑫锐研究精选一年持有期混合型证券投资基金、国联景盛一年持有期混合型证券投资基金、国联恒益纯债债券型证券投资基金、国联恒阳纯债债券型证券投资基金、国联低碳经济3个月持有期混合型证券投资基金、国联景泓一年持有期混合型证券投资基金、国联金融鑫选3个月持有期混合型证券投资基金、国联匠心优选混合型证券投资基金、国联添益进取3个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、国联恒利纯债债券

型证券投资基金、国联高质量成长混合型证券投资基金、国联景惠混合型证券投资基金、国联聚优一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国联恒泽纯债债券型证券投资基金、国联研发创新混合型证券投资基金、国联优势产业混合型证券投资基金、国联医药消费混合型证券投资基金、国联成长先锋一年持有期混合型证券投资基金、国联益海30天滚动持有短债债券型证券投资基金、国联益泓90天滚动持有债券型证券投资基金、国联兴鸿优选混合型证券投资基金、国联恒通纯债债券型证券投资基金、国联融盛双盈债券型证券投资基金、国联养老目标日期2045三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、国联中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、国联恒润纯债债券型证券投资基金、国联添安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)、国联消费精选混合型证券投资基金、国联融誉双华6个月持有期债券型证券投资基金、国联泓安3个月定期开放债券型证券投资基金、国联中债0-3年政策性金融债指数证券投资基金、国联智选先锋股票型证券投资基金、国联益诚30天持有期债券型发起式证券投资基金、国联利率债债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈薪羽	国联央视财经50交易型开放式指数证券投资基金、国联央视财经50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国联中证500交易型开放式指数证券投资基金、国联中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国联智选红利股票型证券投资基金、国联国证钢铁行业	2019-11-28	-	8	陈薪羽先生，中国国籍，毕业于北京大学概率论与数理统计专业，研究生、硕士学位，具有基金从业资格，证券从业年限8年。2015年8月至2016年10月任中国人保寿险首席投资官秘书。2016年10月加入公司，现任多策略投资部基金经理。

	指数型证券投资基金、国联中证煤炭指数型证券投资基金、国联景盛一年持有期混合型证券投资基金、国联智选先锋股票型证券投资基金的基金经理。				
杜超	国联中证煤炭指数型证券投资基金、国联国证钢铁行业指数型证券投资基金、国联中证500交易型开放式指数证券投资基金、国联中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国联央视财经50交易型开放式指数证券投资基金、国联央视财经50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国联高股息精选混合型证券投资基金、国联鑫价值灵活配置混合型证券投资基金、国联创业板两年定期开放混合型证券投资基金、国联新机遇灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。	2023-10-20	-	8	杜超先生,中国国籍,毕业于南京航空航天大学计算机科学与技术专业,本科、学士学位,具有基金从业资格,证券从业年限8年。2013年7月至2016年4月任中国银行软件中心开发五部软件工程师。2016年4月加入公司,现任多策略投资部基金经理。

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司制定了《公平交易管理办法》并严格执行，公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，在研究、决策、交易执行等各环节，通过制度、流程、技术手段等各方面措施确保了公平对待所管理的投资组合，保证公平交易原则的实现。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024年上半年，中证500指数下跌8.96%，本基金作为一只投资于中证500指数的被动型产品，我们采取完全复制的被动投资策略，运用智能指数投资系统进行精细化管理，积极应对基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，严格控制本基金的跟踪偏离度和跟踪误差，给投资者提供一个标准化的中证500指数的投资工具。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国联中证500ETF基金份额净值为1.0866元，本报告期内，基金份额净值增长率为-7.41%，同期业绩比较基准收益率为-8.96%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观层面，世界经济格局步入“大分化”时代，国内与部分海外主要经济体宏观周期联动减弱，在增长、通胀、利率和私人部门杠杆率等维度持续分化。我国与欧美国家之间金融周期的不同步，以及持续大国竞争的贸易摩擦导致中美内部供需失衡，即中国需求不足，美国供给不足。年初至今国内经济有所恢复，但GDP同比增速环比减弱，整体呈现供给恢复好于需求，有效需求不足，微观主体盈利偏弱等问题。

展望下半年，经济仍处于疫情后的恢复期，关注三方面问题：（1）地产的走势；（2）居民资产负债表的修复；（3）出口的不确定性。下半年我国物价同比增速有望小幅回升，预计生猪去产能支撑猪价周期上行，内需边际改善；地产由于政策调整带来预期变化，主要关注存量房收储落地力度及节奏。

随着二季度业绩低于预期的股票逐渐出清，A股盈利同比增长有望稳步恢复。结构上，边际改善、高成长以及供给侧出清的行业存在投资机会。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；设立估值委员会，估值委员会成员由具有专业胜任能力和相关工作经历的高级管理人员、投资研究部门、基金运营部门、风险管理部门、法律合规部门人员组成，负责研究、指导基金估值业务，基金经理根据公司制度参加估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务；使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则及具体估值程序；估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。本基金日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在国联中证500交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《国联中证500交易型开放式指数证券投资基金2024年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国联中证500交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日

资产：			
货币资金	6.4.7.1	2,114,735.57	2,104,233.56
结算备付金		224,419.66	476,447.74
存出保证金		239,855.62	146,017.21
交易性金融资产	6.4.7.2	29,366,839.38	27,078,682.18
其中：股票投资		29,366,839.38	27,078,682.18
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	46,865.05
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		31,945,850.23	29,852,245.74
负债和净资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023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		27,021.76	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		8,156.47	7,599.11
应付托管费		2,718.81	2,533.01

应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	21,636.82	95,467.24
负债合计		59,533.86	105,599.36
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	29,345,700.00	25,345,700.00
未分配利润	6.4.7.8	2,540,616.37	4,400,946.38
净资产合计		31,886,316.37	29,746,646.38
负债和净资产总计		31,945,850.23	29,852,245.74

注：报告截止日2024年06月30日，基金份额总额29,345,700.00份，份额净值1.0866元。

6.2 利润表

会计主体：国联中证500交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至202 3年06月30日
一、营业总收入		-2,284,541.00	1,396,753.19
1.利息收入		11,020.25	10,250.64
其中：存款利息收入	6.4.7.9	11,020.25	10,250.64
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）		-531,945.69	-87,990.58

其中：股票投资收益	6.4.7.10	-868,131.54	-450,441.27
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	8,397.45
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-73,068.76	-2,485.03
股利收益	6.4.7.16	409,254.61	356,538.27
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.17	-1,708,608.71	1,473,863.89
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.18	-55,006.85	629.24
减：二、营业总支出		77,827.72	109,249.71
1.管理人报酬		47,360.41	51,902.25
2.托管费		15,786.75	17,300.80
3.销售服务费		-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6.信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7.税金及附加		-	144.28
8.其他费用	6.4.7.20	14,680.56	39,902.38
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		-2,362,368.72	1,287,503.48
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		-2,362,368.72	1,287,503.48

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-2,362,368.72	1,287,503.48

6.3 净资产变动表

会计主体：国联中证500交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	25,345,700.00	4,400,946.38	29,746,646.38
二、本期期初净资产	25,345,700.00	4,400,946.38	29,746,646.38
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	4,000,000.00	-1,860,330.01	2,139,669.99
（一）、综合收益总额	-	-2,362,368.72	-2,362,368.72
（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）	4,000,000.00	502,038.71	4,502,038.71
其中：1.基金申购款	6,000,000.00	729,816.44	6,729,816.44
2.基金赎回款	-2,000,000.00	-227,777.73	-2,227,777.73
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-

四、本期期末净资产	29,345,700.00	2,540,616.37	31,886,316.37
项目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	27,345,700.00	6,813,928.32	34,159,628.32
二、本期期初净资产	27,345,700.00	6,813,928.32	34,159,628.32
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,000,000.00	559,482.56	-1,440,517.44
（一）、综合收益总额	-	1,287,503.48	1,287,503.48
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-2,000,000.00	-728,020.92	-2,728,020.92
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-2,000,000.00	-728,020.92	-2,728,020.92
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	25,345,700.00	7,373,410.88	32,719,110.88

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

王瑶

周妹云

李克

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

根据本基金的基金管理人2023年9月6日发布的《国联基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》本基金自2023年9月8日起更名为国联中证500交易型开放式指数证券投资基金。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和基金合同等有关规定,本基金主要投资于标的指数即中证500指数成份股和备选成份股。为更好地实现基金的投资目标,本基金还可投资于国内依法发行上市的非成份股(包括中小板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准上市或同意注册的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券等)、货币市场工具、债券回购、资产支持证券、银行存款、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金业绩比较基准为中证500指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则--基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称"企业会计准则")编制,同时,在信息披露和估值方面,也参考了中国

证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2024年06月30日的财务状况以及2024年半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局国家税务总局财税[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问

题的通知》、财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2、对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

3、对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴个人所得税，个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

5、基金卖出股票缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2024年06月30日
活期存款	2,114,735.57
等于：本金	2,114,310.78
加：应计利息	424.79
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	2,114,735.57

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	33,301,280.51	-	29,366,839.38	-3,934,441.13
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	33,301,280.51	-	29,366,839.38	-3,934,441.13

注：股票投资的公允价值和股票投资的估值增值均包含可退替代款的估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	2,050,320.00	-	-	-
--股指期货	2,050,320.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,050,320.00	-	-	-

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

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2407	中证500股指期货2407合约	2.00	1,967,040.00	-83,280.00
合计				-83,280.00
减：可抵销 期货暂收 款				-83,280.00
净额				-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.5 其他资产

注：无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	9,204.05
其中：交易所市场	9,204.05
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	9,944.48
应付指数使用费	2,488.29
合计	21,636.82

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	25,345,700.00	25,345,700.00

本期申购	6,000,000.00	6,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-2,000,000.00	-2,000,000.00
本期末	29,345,700.00	29,345,700.00

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	14,395,551.51	-9,994,605.13	4,400,946.38
本期期初	14,395,551.51	-9,994,605.13	4,400,946.38
本期利润	-653,760.01	-1,708,608.71	-2,362,368.72
本期基金份额交易产生的变动数	2,230,564.69	-1,728,525.98	502,038.71
其中：基金申购款	3,338,809.75	-2,608,993.31	729,816.44
基金赎回款	-1,108,245.06	880,467.33	-227,777.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,972,356.19	-13,431,739.82	2,540,616.37

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
活期存款利息收入	8,055.14
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	2,876.47
其他	88.64
合计	11,020.25

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-779,333.82
股票投资收益——赎回差价收入	-88,797.72
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	-868,131.54

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
卖出股票成交总额	8,035,006.80
减：卖出股票成本总额	8,794,892.18
减：交易费用	19,448.44
买卖股票差价收入	-779,333.82

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
赎回基金份额对价总额	2,227,777.73
减：现金支付赎回款总额	1,219,496.73
减：赎回股票成本总额	1,097,078.72
减：交易费用	-
赎回差价收入	-88,797.72

6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.11 基金投资收益

注：无。

6.4.7.12 债券投资收益

注：无。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

注：无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：无。

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

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
期货投资	-73,068.76

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	409,254.61
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	409,254.61

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
1.交易性金融资产	-1,631,408.71
——股票投资	-1,631,408.71
——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	-77,200.00
—权证投资	-
—期货投资	-77,200.00
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-1,708,608.71

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
基金赎回费收入	-
ETF基金替代损益	-55,006.85
合计	-55,006.85

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

6.4.7.19 信用减值损失

注：无。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	9,944.48

信息披露费	-
证券出借违约金	-
指数使用费	4,736.08
合计	14,680.56

6.4.7.21 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：无。

6.4.10.1.2 权证交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券交易

注：无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至20 24年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至20 23年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	47,360.41	51,902.25
其中：应支付销售机构的客户维护费	-	-
应支付基金管理人的净管理费	47,360.41	51,902.25

注：①支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值的年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.30%/当年天数。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间

	2024年01月01日至2024年06月30日	2023年01月01日至2023年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	15,786.75	17,300.80

注：①支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值的年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024年06月30日		上年度末 2023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
国联中证500ETF联接	20,262,000.00	69.05%	20,662,000.00	81.52%

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

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国光大	2,114,735.57	8,055.14	2,000,548.83	5,700.88

银行股份 有限公司				
--------------	--	--	--	--

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

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

于2024年6月30日，本基金持有6000股股东方国联证券的A股普通股，成本总额为人民币64578.84元，占基金净资产的比率为0.2%。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

注：无。

6.4.12 期末（2024年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的信用评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券、基金，除在附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注6.4.12.3中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在1个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合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。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时关于未来现金流的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年0 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	2,114,735.57	-	-	-	2,114,735.57
结算备 付金	224,419.66	-	-	-	224,419.66
存出保 证金	239,855.62	-	-	-	239,855.62
交易性 金融资 产	-	-	-	29,366,839.38	29,366,839.38
资产总 计	2,579,010.85	-	-	29,366,839.38	31,945,850.23
负债					
应付清 算款	-	-	-	27,021.76	27,021.76
应付管	-	-	-	8,156.47	8,156.47

理人报 酬					
应付托 管费	-	-	-	2,718.81	2,718.81
其他负 债	-	-	-	21,636.82	21,636.82
负债总 计	-	-	-	59,533.86	59,533.86
利率敏 感度缺 口	2,579,010.85	-	-	29,307,305.52	31,886,316.37
上年度 末 2023年1 2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	2,104,233.56	-	-	-	2,104,233.56
结算备 付金	476,447.74	-	-	-	476,447.74
存出保 证金	146,017.21	-	-	-	146,017.21
交易性 金融资 产	-	-	-	27,078,682.18	27,078,682.18
应收清 算款	-	-	-	46,865.05	46,865.05
资产总 计	2,726,698.51	-	-	27,125,547.23	29,852,245.74
负债					
应付管 理人报 酬	-	-	-	7,599.11	7,599.11
应付托 管费	-	-	-	2,533.01	2,533.01
其他负	-	-	-	95,467.24	95,467.24

债					
负债总计	-	-	-	105,599.36	105,599.36
利率敏感度缺口	2,726,698.51	-	-	27,019,947.87	29,746,646.38

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日		上年度末 2023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	29,366,839.38	92.10	27,078,682.18	91.03
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	29,366,839.38	92.10	27,078,682.18	91.03

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、估测组合市场价格风险的敏感性为考察沪深300指数变动时，因股票资产变动导致对基金资产净值的影响金额；		
	2、假定沪深300指数变化5%，其他市场变量不变；		
	3、Beta系数是根据组合在过去一年的净值数据和沪深300指数数据回归得出，对于成立不足一年的组合，取自成立以来的数据计算。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	沪深300指数上升5%	1,790,557.48	1,187,111.43
	沪深300指数下降5%	-1,790,557.48	-1,187,111.43

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

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	29,366,839.38	27,078,682.18
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	29,366,839.38	27,078,682.18

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§7 投资组合报告**7.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	29,366,839.38	91.93
	其中：股票	29,366,839.38	91.93
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	2,339,155.23	7.32
8	其他各项资产	239,855.62	0.75
9	合计	31,945,850.23	100.00

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

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合**7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合**

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	188,480.00	0.59
B	采矿业	1,399,682.00	4.39

C	制造业	18,550,713.95	58.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,076,388.60	3.38
E	建筑业	305,857.00	0.96
F	批发和零售业	633,410.32	1.99
G	交通运输、仓储和邮政业	555,140.58	1.74
H	住宿和餐饮业	94,844.00	0.30
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,107,306.76	6.61
J	金融业	2,797,997.85	8.77
K	房地产业	339,070.00	1.06
L	租赁和商务服务业	229,580.00	0.72
M	科学研究和技术服务业	234,449.72	0.74
N	水利、环境和公共设施管理业	135,058.60	0.42
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	33,660.00	0.11
Q	卫生和社会工作	182,487.00	0.57
R	文化、体育和娱乐业	449,209.00	1.41
S	综合	53,504.00	0.17
	合计	29,366,839.38	92.10

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	300502	新易盛	3,600	379,980.00	1.19
2	002028	思源电气	3,099	207,323.10	0.65
3	601058	赛轮轮胎	13,400	187,600.00	0.59
4	600066	宇通客车	6,700	172,860.00	0.54
5	002340	格林美	26,200	166,894.00	0.52
6	000933	神火股份	8,000	161,840.00	0.51
7	601077	渝农商行	31,500	158,130.00	0.50
8	000988	华工科技	5,100	152,643.00	0.48
9	601168	西部矿业	8,500	152,575.00	0.48
10	688169	石头科技	380	149,188.00	0.47
11	300394	天孚通信	1,660	146,777.20	0.46
12	000423	东阿阿胶	2,300	143,980.00	0.45
13	002384	东山精密	6,900	142,830.00	0.45
14	000630	铜陵有色	39,100	141,151.00	0.44
15	600418	江淮汽车	8,900	140,976.00	0.44
16	601233	桐昆股份	8,600	137,256.00	0.43
16	600988	赤峰黄金	8,400	137,256.00	0.43
18	002625	光启技术	7,600	131,860.00	0.41
19	600096	云天化	6,500	126,230.00	0.40
20	601567	三星医疗	3,600	126,000.00	0.40
21	000400	许继电气	3,600	123,876.00	0.39
22	002156	通富微电	5,400	120,906.00	0.38
23	002128	电投能源	5,700	120,270.00	0.38
24	601555	东吴证券	20,200	119,180.00	0.37
25	002273	水晶光电	7,000	118,860.00	0.37
26	002078	太阳纸业	8,500	118,575.00	0.37
27	688777	中控技术	3,100	116,870.00	0.37
28	601128	常熟银行	15,300	115,821.00	0.36

29	600885	宏发股份	4,180	115,702.40	0.36
30	300207	欣旺达	7,600	115,292.00	0.36
31	002532	天山铝业	14,200	115,162.00	0.36
32	600352	浙江龙盛	13,200	113,388.00	0.36
33	002223	鱼跃医疗	3,000	112,800.00	0.35
34	600398	海澜之家	12,200	112,728.00	0.35
35	002138	顺络电子	4,100	112,586.00	0.35
36	002966	苏州银行	14,890	111,675.00	0.35
37	601108	财通证券	16,500	109,065.00	0.34
38	002353	杰瑞股份	3,100	108,748.00	0.34
39	600765	中航重机	5,280	107,712.00	0.34
40	002185	华天科技	13,000	105,950.00	0.33
41	600879	航天电子	13,400	104,118.00	0.33
42	002517	恺英网络	10,900	104,095.00	0.33
43	603606	东方电缆	2,100	102,501.00	0.32
44	301236	软通动力	2,900	102,109.00	0.32
45	600873	梅花生物	10,100	101,202.00	0.32
46	601577	长沙银行	12,300	100,614.00	0.32
47	600177	雅戈尔	14,100	100,392.00	0.31
48	600109	国金证券	13,200	99,660.00	0.31
49	600079	人福医药	5,800	99,586.00	0.31
50	300003	乐普医疗	6,700	99,428.00	0.31
51	300017	网宿科技	12,400	97,960.00	0.31
52	002738	中矿资源	3,640	97,552.00	0.31
53	600497	驰宏锌锗	18,100	96,654.00	0.30
54	600060	海信视像	3,900	96,486.00	0.30
55	603160	汇顶科技	1,400	96,250.00	0.30
56	300136	信维通信	4,900	95,942.00	0.30
57	002202	金风科技	14,000	94,080.00	0.30
58	000932	华菱钢铁	21,100	93,473.00	0.29
59	002739	万达电影	7,700	93,093.00	0.29

60	000683	远兴能源	13,300	91,903.00	0.29
61	688617	惠泰医疗	200	91,220.00	0.29
62	002465	海格通信	8,800	91,168.00	0.29
63	600348	华阳股份	9,150	91,134.00	0.29
64	603979	金诚信	1,800	90,954.00	0.29
65	600985	淮北矿业	5,400	90,396.00	0.28
66	000009	中国宝安	10,500	90,300.00	0.28
67	688099	晶晨股份	1,516	89,929.12	0.28
68	002281	光迅科技	2,400	89,688.00	0.28
69	600536	中国软件	2,979	89,131.68	0.28
70	002444	巨星科技	3,600	88,920.00	0.28
71	002436	兴森科技	8,600	88,752.00	0.28
72	688188	柏楚电子	480	88,584.00	0.28
73	300474	景嘉微	1,400	88,522.00	0.28
74	000878	云南铜业	7,100	88,466.00	0.28
75	688122	西部超导	2,300	88,136.00	0.28
76	002409	雅克科技	1,400	88,074.00	0.28
77	600642	申能股份	9,900	87,417.00	0.27
78	002008	大族激光	4,200	87,360.00	0.27
79	002797	第一创业	17,100	87,039.00	0.27
80	601615	明阳智能	9,200	86,848.00	0.27
81	600298	安琪酵母	3,100	86,583.00	0.27
82	300054	鼎龙股份	3,800	86,184.00	0.27
83	000039	中集集团	9,300	86,118.00	0.27
84	601990	南京证券	11,200	86,016.00	0.27
85	000066	中国长城	9,800	85,750.00	0.27
86	300012	华测检测	8,500	85,510.00	0.27
87	600839	四川长虹	18,800	84,412.00	0.26
88	002673	西部证券	13,600	84,184.00	0.26
89	601666	平煤股份	7,500	84,000.00	0.26
90	600529	山东药玻	3,300	83,622.00	0.26

91	601179	中国西电	10,400	83,616.00	0.26
92	603596	伯特利	2,100	81,690.00	0.26
93	000783	长江证券	16,900	81,627.00	0.26
94	601717	郑煤机	5,500	81,400.00	0.26
95	300002	神州泰岳	10,000	81,200.00	0.25
96	000831	中国稀土	3,200	81,120.00	0.25
97	002432	九安医疗	2,000	81,080.00	0.25
98	603816	顾家家居	2,500	80,725.00	0.25
99	000728	国元证券	13,300	80,598.00	0.25
100	300395	菲利华	2,600	79,950.00	0.25
101	000703	恒逸石化	11,200	79,408.00	0.25
102	000738	航发控制	3,942	79,115.94	0.25
103	600862	中航高科	4,200	78,876.00	0.25
104	601997	贵阳银行	14,900	78,523.00	0.25
105	601198	东兴证券	9,800	78,008.00	0.24
106	000960	锡业股份	5,000	77,450.00	0.24
107	601696	中银证券	8,500	77,180.00	0.24
108	600863	内蒙华电	16,600	77,024.00	0.24
109	688525	佰维存储	1,200	76,980.00	0.24
110	601162	天风证券	35,300	76,954.00	0.24
111	002595	豪迈科技	2,000	76,340.00	0.24
112	002155	湖南黄金	4,200	76,020.00	0.24
113	688120	华海清科	400	75,832.00	0.24
114	300724	捷佳伟创	1,400	75,614.00	0.24
115	688180	君实生物	2,600	75,530.00	0.24
116	600521	华海药业	4,400	75,020.00	0.24
117	002472	双环传动	3,400	74,868.00	0.23
118	002984	森麒麟	3,100	74,679.00	0.23
119	002294	信立泰	2,800	74,564.00	0.23
120	300001	特锐德	3,700	74,444.00	0.23
121	600141	兴发集团	3,900	74,412.00	0.23

122	603345	安井食品	1,000	74,310.00	0.23
123	300037	新宙邦	2,600	74,256.00	0.23
124	600549	厦门钨业	4,300	74,175.00	0.23
125	000921	海信家电	2,300	74,152.00	0.23
126	600699	均胜电子	5,000	74,100.00	0.23
127	600038	中直股份	1,800	73,998.00	0.23
128	002407	多氟多	6,040	73,869.20	0.23
129	603939	益丰药房	2,996	73,551.80	0.23
130	600820	隧道股份	11,200	73,136.00	0.23
131	600546	山煤国际	5,000	73,100.00	0.23
132	300699	光威复材	2,940	73,000.20	0.23
133	600369	西南证券	20,300	72,674.00	0.23
134	600872	中炬高新	3,200	72,608.00	0.23
135	002195	岩山科技	28,900	72,539.00	0.23
136	603338	浙江鼎力	1,200	72,504.00	0.23
137	002064	华峰化学	10,100	72,417.00	0.23
138	301358	湖南裕能	2,300	72,358.00	0.23
139	600895	张江高科	3,900	72,072.00	0.23
140	300285	国瓷材料	4,000	71,400.00	0.22
141	002262	恩华药业	3,000	71,220.00	0.22
142	300866	安克创新	1,000	71,210.00	0.22
143	000021	深科技	4,700	71,064.00	0.22
144	601000	唐山港	15,100	70,970.00	0.22
145	603589	口子窖	1,800	70,542.00	0.22
146	300146	汤臣倍健	5,200	70,460.00	0.22
147	600021	上海电力	7,100	70,219.00	0.22
148	600486	扬农化工	1,240	69,998.00	0.22
149	603087	甘李药业	1,500	69,480.00	0.22
150	002850	科达利	900	68,742.00	0.22
151	300073	当升科技	2,000	68,620.00	0.22
152	600704	物产中大	15,800	68,572.00	0.22

153	300058	蓝色光标	12,600	68,544.00	0.21
154	002756	永兴材料	1,900	67,982.00	0.21
155	601966	玲珑轮胎	3,700	67,969.00	0.21
156	600155	华创云信	11,500	67,965.00	0.21
157	300114	中航电测	1,500	67,875.00	0.21
158	600153	建发股份	7,600	67,868.00	0.21
159	000830	鲁西化工	5,800	67,222.00	0.21
160	000513	丽珠集团	1,800	66,978.00	0.21
161	603179	新泉股份	1,700	66,708.00	0.21
162	600118	中国卫星	3,000	66,690.00	0.21
163	600583	海油工程	11,200	66,192.00	0.21
164	002558	巨人网络	7,000	66,080.00	0.21
165	002152	广电运通	6,300	65,898.00	0.21
166	000591	太阳能	13,900	65,469.00	0.21
167	300529	健帆生物	2,400	65,304.00	0.20
168	601156	东航物流	3,200	65,120.00	0.20
169	000623	吉林敖东	4,800	64,320.00	0.20
170	002385	大北农	16,700	64,295.00	0.20
171	300144	宋城演艺	8,000	64,240.00	0.20
172	600970	中材国际	5,300	63,918.00	0.20
173	002439	启明星辰	3,700	63,862.00	0.20
174	600380	健康元	5,700	63,669.00	0.20
175	688065	凯赛生物	1,400	63,546.00	0.20
176	601216	君正集团	17,200	63,468.00	0.20
177	000723	美锦能源	13,200	62,832.00	0.20
178	600143	金发科技	9,500	62,795.00	0.20
179	000729	燕京啤酒	7,100	62,693.00	0.20
180	600998	九州通	12,835	62,634.80	0.20
181	605358	立昂微	2,700	62,478.00	0.20
182	600282	南钢股份	12,500	62,250.00	0.20
183	300373	扬杰科技	1,600	62,240.00	0.20

184	300251	光线传媒	7,400	62,234.00	0.20
185	600637	东方明珠	10,200	62,016.00	0.19
186	300383	光环新网	7,300	61,685.00	0.19
187	300677	英科医疗	2,300	61,663.00	0.19
188	600516	方大炭素	14,300	61,633.00	0.19
189	000519	中兵红箭	4,200	61,614.00	0.19
190	000636	风华高科	4,700	61,382.00	0.19
191	300024	机器人	6,300	61,362.00	0.19
192	600392	盛和资源	7,100	61,202.00	0.19
193	002958	青农商行	22,600	60,568.00	0.19
194	601665	齐鲁银行	12,300	60,393.00	0.19
195	002025	航天电器	1,300	60,294.00	0.19
196	600909	华安证券	14,300	60,203.00	0.19
197	002044	美年健康	15,900	60,102.00	0.19
198	600008	首创环保	22,410	60,058.80	0.19
199	000818	航锦科技	2,700	59,616.00	0.19
200	000883	湖北能源	9,900	59,499.00	0.19
201	600763	通策医疗	1,100	59,455.00	0.19
202	601016	节能风电	19,820	59,261.80	0.19
203	000629	钒钛股份	23,700	59,250.00	0.19
204	300088	长信科技	12,500	58,750.00	0.18
205	600867	通化东宝	7,000	58,590.00	0.18
206	600511	国药股份	1,900	58,501.00	0.18
207	600170	上海建工	27,200	58,480.00	0.18
208	000997	新大陆	4,200	58,422.00	0.18
209	600582	天地科技	8,400	57,876.00	0.18
210	601456	国联证券	6,000	57,840.00	0.18
211	600499	科达制造	6,800	57,324.00	0.18
212	601933	永辉超市	23,100	57,288.00	0.18
213	600498	烽火通信	3,600	57,240.00	0.18
214	000598	兴蓉环境	7,600	57,152.00	0.18

215	600566	济川药业	1,800	57,078.00	0.18
216	601991	大唐发电	18,900	56,889.00	0.18
217	600004	白云机场	6,000	56,880.00	0.18
218	000750	国海证券	19,500	56,745.00	0.18
219	600535	天士力	4,500	56,610.00	0.18
220	002120	韵达股份	7,300	56,502.00	0.18
221	002261	拓维信息	5,100	56,457.00	0.18
222	000060	中金岭南	13,300	56,392.00	0.18
223	603000	人民网	2,800	55,972.00	0.18
224	600580	卧龙电驱	4,600	55,890.00	0.18
225	300568	星源材质	6,800	55,760.00	0.17
226	300118	东方日升	4,600	55,660.00	0.17
227	002430	杭氧股份	2,500	55,625.00	0.17
228	002429	兆驰股份	11,500	55,315.00	0.17
229	600166	福田汽车	24,500	55,125.00	0.17
230	600129	太极集团	1,900	54,948.00	0.17
231	002939	长城证券	8,200	54,940.00	0.17
232	600325	华发股份	8,400	54,600.00	0.17
233	600816	建元信托	20,000	54,200.00	0.17
234	600673	东阳光	7,600	53,504.00	0.17
235	688213	思特威	1,100	53,350.00	0.17
236	000893	亚钾国际	3,300	53,328.00	0.17
237	603156	养元饮品	2,500	53,175.00	0.17
238	603927	中科软	2,936	53,112.24	0.17
239	300601	康泰生物	3,400	53,074.00	0.17
240	002508	老板电器	2,400	53,040.00	0.17
241	000027	深圳能源	7,260	52,998.00	0.17
242	300765	新诺威	2,100	52,983.00	0.17
243	601231	环旭电子	3,300	52,965.00	0.17
244	601636	旗滨集团	8,200	52,890.00	0.17
245	600754	锦江酒店	2,300	52,854.00	0.17

246	002926	华西证券	8,000	52,720.00	0.17
247	002624	完美世界	6,900	52,440.00	0.16
248	300487	蓝晓科技	1,250	52,200.00	0.16
249	002653	海思科	1,700	52,190.00	0.16
250	603228	景旺电子	1,640	52,152.00	0.16
251	601866	中远海发	20,201	52,118.58	0.16
252	000998	隆平高科	5,300	52,099.00	0.16
253	603077	和邦生物	31,500	51,975.00	0.16
254	300253	卫宁健康	8,800	51,920.00	0.16
255	603486	科沃斯	1,100	51,898.00	0.16
256	603568	伟明环保	2,520	51,861.60	0.16
257	002299	圣农发展	3,800	51,832.00	0.16
258	600737	中粮糖业	5,400	51,786.00	0.16
259	002497	雅化集团	5,800	51,736.00	0.16
260	603290	斯达半导	600	51,666.00	0.16
261	300604	长川科技	1,900	51,623.00	0.16
262	002065	东华软件	11,400	51,528.00	0.16
263	688052	纳芯微	500	51,390.00	0.16
264	002414	高德红外	8,700	51,243.00	0.16
265	002500	山西证券	10,900	51,230.00	0.16
266	002056	横店东磁	4,100	51,127.00	0.16
267	603298	杭叉集团	2,600	51,064.00	0.16
268	601958	金钼股份	4,900	51,009.00	0.16
269	600655	豫园股份	9,900	50,985.00	0.16
270	300567	精测电子	900	50,859.00	0.16
271	603658	安图生物	1,100	50,677.00	0.16
272	688772	珠海冠宇	3,400	50,660.00	0.16
273	600131	国网信通	3,000	50,610.00	0.16
274	300390	天华新能	2,940	50,509.20	0.16
275	600373	中文传媒	3,400	50,456.00	0.16
276	300009	安科生物	5,904	50,420.16	0.16

277	002368	太极股份	2,220	50,061.00	0.16
278	300763	锦浪科技	1,200	49,968.00	0.16
279	600707	彩虹股份	7,300	49,713.00	0.16
280	002507	涪陵榨菜	4,040	49,490.00	0.16
281	603885	吉祥航空	4,500	49,455.00	0.16
282	601611	中国核建	6,100	49,349.00	0.15
283	002372	伟星新材	3,200	49,344.00	0.15
284	688002	睿创微纳	1,758	49,171.26	0.15
285	000887	中鼎股份	4,000	48,960.00	0.15
286	688390	固德威	868	48,712.16	0.15
287	002203	海亮股份	6,100	48,678.00	0.15
288	603225	新凤鸣	3,100	48,329.00	0.15
289	600755	厦门国贸	6,700	48,039.00	0.15
290	688114	华大智造	1,000	47,410.00	0.15
291	603893	瑞芯微	800	47,336.00	0.15
292	688385	复旦微电	1,500	47,070.00	0.15
293	600859	王府井	4,000	46,960.00	0.15
294	600801	华新水泥	3,400	46,750.00	0.15
295	600416	湘电股份	4,700	46,718.00	0.15
296	600995	南网储能	4,800	46,368.00	0.15
297	300296	利亚德	10,300	46,350.00	0.15
298	002683	广东宏大	2,300	46,299.00	0.15
299	600884	杉杉股份	5,700	46,284.00	0.15
300	002506	协鑫集成	23,800	46,172.00	0.14
301	600390	五矿资本	11,400	46,170.00	0.14
302	300070	碧水源	11,000	46,090.00	0.14
303	002831	裕同科技	1,800	46,062.00	0.14
304	002244	滨江集团	6,300	45,738.00	0.14
305	002019	亿帆医药	3,700	45,732.00	0.14
306	600563	法拉电子	600	45,708.00	0.14
307	600435	北方导航	5,300	45,686.00	0.14

308	688521	芯原股份	1,700	45,475.00	0.14
309	600483	福能股份	3,900	45,474.00	0.14
310	603379	三美股份	1,160	45,402.40	0.14
311	600329	达仁堂	1,400	45,346.00	0.14
312	600739	辽宁成大	5,400	45,198.00	0.14
313	000050	深天马 A	6,200	45,136.00	0.14
314	601598	中国外运	8,000	45,040.00	0.14
314	600399	抚顺特钢	8,000	45,040.00	0.14
316	600598	北大荒	3,600	44,964.00	0.14
317	600901	江苏金租	8,860	44,743.00	0.14
318	601098	中南传媒	3,600	44,712.00	0.14
319	300748	金力永磁	3,440	44,582.40	0.14
320	002572	索菲亚	2,900	44,457.00	0.14
321	000155	川能动力	4,100	44,157.00	0.14
322	002080	中材科技	3,400	43,860.00	0.14
323	001286	陕西能源	3,800	43,814.00	0.14
324	002568	百润股份	2,600	43,758.00	0.14
325	600848	上海临港	4,800	43,728.00	0.14
326	300803	指南针	1,200	43,692.00	0.14
327	002936	郑州银行	25,205	43,604.65	0.14
328	002373	千方科技	4,800	43,536.00	0.14
329	002487	大金重工	1,900	43,472.00	0.14
330	000563	陕国投 A	15,640	43,010.00	0.13
331	002240	盛新锂能	3,200	42,944.00	0.13
332	002268	电科网安	3,000	42,690.00	0.13
333	000778	新兴铸管	12,200	42,456.00	0.13
334	600968	海油发展	10,300	42,436.00	0.13
335	603858	步长制药	2,800	42,420.00	0.13
336	300595	欧普康视	2,700	42,336.00	0.13
337	002557	洽洽食品	1,500	42,285.00	0.13
338	300676	华大基因	1,200	42,012.00	0.13

339	600258	首旅酒店	3,400	41,990.00	0.13
340	601212	白银有色	15,100	41,978.00	0.13
341	603712	七一二	2,300	41,837.00	0.13
342	688538	和辉光电	21,100	41,778.00	0.13
343	601928	凤凰传媒	3,800	41,648.00	0.13
344	603883	老百姓	2,252	41,346.72	0.13
345	600271	航天信息	5,600	41,216.00	0.13
346	600062	华润双鹤	2,100	41,118.00	0.13
347	688017	绿的谐波	500	41,050.00	0.13
348	600528	中铁工业	5,600	40,992.00	0.13
349	600977	中国电影	3,800	40,888.00	0.13
350	601155	新城控股	4,600	40,802.00	0.13
351	000709	河钢股份	21,000	40,740.00	0.13
352	600959	江苏有线	15,300	40,392.00	0.13
353	002531	天顺风能	4,500	40,230.00	0.13
354	002408	齐翔腾达	7,160	40,096.00	0.13
355	603688	石英股份	1,350	39,973.50	0.13
356	601118	海南橡胶	8,700	39,585.00	0.12
357	000739	普洛药业	2,900	39,353.00	0.12
358	000825	太钢不锈	11,600	39,208.00	0.12
359	300558	贝达药业	1,200	39,060.00	0.12
360	688331	荣昌生物	900	38,880.00	0.12
361	600056	中国医药	3,800	38,456.00	0.12
362	603882	金域医学	1,400	38,066.00	0.12
363	000987	越秀资本	7,670	38,043.20	0.12
364	601399	国机重装	14,700	37,926.00	0.12
365	600906	财达证券	6,600	37,818.00	0.12
366	603737	三棵树	1,040	37,720.80	0.12
367	600517	国网英大	8,700	37,671.00	0.12
368	600378	昊华科技	1,300	37,570.00	0.12
369	688005	容百科技	1,600	37,248.00	0.12

370	002266	浙富控股	13,300	37,107.00	0.12
371	603456	九洲药业	2,700	37,044.00	0.12
372	688200	华峰测控	400	36,700.00	0.12
373	601019	山东出版	3,100	36,642.00	0.11
374	000937	冀中能源	5,400	36,180.00	0.11
375	600871	石化油服	20,700	36,018.00	0.11
376	300212	易华录	2,120	35,679.60	0.11
377	603444	吉比特	200	35,602.00	0.11
378	603529	爱玛科技	1,300	35,529.00	0.11
379	688567	孚能科技	3,700	35,520.00	0.11
380	603650	彤程新材	1,200	35,460.00	0.11
381	600925	苏能股份	7,000	35,350.00	0.11
382	002423	中粮资本	4,700	35,203.00	0.11
383	600316	洪都航空	2,100	34,923.00	0.11
384	600612	老凤祥	600	34,914.00	0.11
385	001227	兰州银行	14,500	34,510.00	0.11
386	000032	深桑达 A	2,300	34,454.00	0.11
387	600208	新湖中宝	21,700	34,286.00	0.11
388	688032	禾迈股份	298	34,204.44	0.11
389	600098	广州发展	5,300	33,920.00	0.11
390	601965	中国汽研	2,000	33,780.00	0.11
391	688220	翱捷科技	900	33,714.00	0.11
392	002607	中公教育	22,000	33,660.00	0.11
393	601608	中信重工	8,800	33,528.00	0.11
394	601298	青岛港	3,500	33,460.00	0.10
395	688063	派能科技	840	33,356.40	0.10
396	600578	京能电力	10,200	33,048.00	0.10
397	002670	国盛金控	3,900	33,033.00	0.10
398	688297	中无人机	1,000	33,030.00	0.10
399	688234	天岳先进	700	32,844.00	0.10
400	600663	陆家嘴	3,700	32,634.00	0.10

401	300357	我武生物	1,600	32,352.00	0.10
402	603233	大参林	2,260	32,318.00	0.10
403	688301	奕瑞科技	280	32,264.40	0.10
404	603728	鸣志电器	800	32,184.00	0.10
405	601106	中国一重	13,900	32,109.00	0.10
406	600500	中化国际	9,100	31,759.00	0.10
407	600377	宁沪高速	2,500	31,500.00	0.10
408	300776	帝尔激光	680	31,252.80	0.10
409	300438	鹏辉能源	1,700	31,178.00	0.10
410	000785	居然之家	12,800	31,104.00	0.10
411	600967	内蒙一机	4,300	30,960.00	0.10
412	688561	奇安信	1,300	30,706.00	0.10
413	002865	钧达股份	800	30,704.00	0.10
414	688516	奥特维	732	30,604.92	0.10
415	600315	上海家化	1,700	30,226.00	0.09
416	600350	山东高速	3,400	30,090.00	0.09
417	000958	电投产融	8,200	30,012.00	0.09
418	000559	万向钱潮	6,700	29,882.00	0.09
419	601568	北元集团	8,040	29,828.40	0.09
420	688425	铁建重工	8,100	29,808.00	0.09
420	688349	三一重能	1,200	29,808.00	0.09
422	000537	中绿电	3,100	29,543.00	0.09
423	600827	百联股份	4,000	29,520.00	0.09
424	000156	华数传媒	4,700	29,516.00	0.09
425	002608	江苏国信	3,800	29,450.00	0.09
426	688536	思瑞浦	300	29,343.00	0.09
427	603707	健友股份	2,468	29,319.84	0.09
428	300888	稳健医疗	1,140	28,842.00	0.09
429	003031	中瓷电子	620	28,668.80	0.09
430	603826	坤彩科技	980	28,390.60	0.09
431	002690	美亚光电	1,706	28,149.00	0.09

432	300682	朗新集团	3,300	28,083.00	0.09
433	002867	周大生	2,150	28,079.00	0.09
434	600126	杭钢股份	6,800	27,948.00	0.09
435	603517	绝味食品	1,800	27,720.00	0.09
436	003022	联泓新科	2,000	27,420.00	0.09
437	000967	盈峰环境	6,400	27,072.00	0.08
438	603218	日月股份	2,600	26,702.00	0.08
439	600481	双良节能	5,700	26,619.00	0.08
440	600361	创新新材	6,600	26,598.00	0.08
441	600339	中油工程	8,500	26,520.00	0.08
442	600032	浙江新能	3,600	26,208.00	0.08
443	000898	鞍钢股份	12,200	25,864.00	0.08
444	603786	科博达	400	25,660.00	0.08
445	600095	湘财股份	4,300	25,628.00	0.08
446	003035	南网能源	5,700	25,080.00	0.08
447	688778	厦钨新能	800	24,992.00	0.08
448	301267	华夏眼科	1,200	24,864.00	0.08
449	600808	马钢股份	12,200	24,644.00	0.08
450	603127	昭衍新药	1,836	24,363.72	0.08
451	688475	萤石网络	700	23,877.00	0.07
452	002563	森马服饰	4,100	23,821.00	0.07
453	002153	石基信息	4,144	23,745.12	0.07
454	688248	南网科技	800	23,704.00	0.07
455	688520	神州细胞	600	23,610.00	0.07
456	601228	广州港	7,600	23,180.00	0.07
457	000539	粤电力A	4,500	22,860.00	0.07
458	688779	五矿新能	4,900	22,687.00	0.07
459	600928	西安银行	6,800	22,236.00	0.07
460	603185	弘元绿能	1,300	22,217.00	0.07
461	001203	大中矿业	2,300	22,103.00	0.07
462	000401	冀东水泥	5,400	21,924.00	0.07

463	000959	首钢股份	7,900	21,488.00	0.07
464	001872	招商港口	1,100	21,175.00	0.07
465	688006	杭可科技	1,200	20,940.00	0.07
466	688029	南微医学	340	20,930.40	0.07
467	603305	旭升集团	1,900	20,064.00	0.06
468	603056	德邦股份	1,500	19,650.00	0.06
469	600764	中国海防	1,000	19,630.00	0.06
470	002518	科士达	1,100	19,470.00	0.06
471	600299	安迪苏	2,000	19,400.00	0.06
472	601139	深圳燃气	2,900	19,372.00	0.06
473	603317	天味食品	1,567	17,879.47	0.06
474	688172	燕东微	1,100	17,798.00	0.06
475	300861	美畅股份	900	17,415.00	0.05
476	301029	怡合达	880	17,300.80	0.05
477	688387	信科移动	3,400	17,136.00	0.05
478	688276	百克生物	600	17,022.00	0.05
479	600927	永安期货	1,400	15,610.00	0.05
480	002791	坚朗五金	600	15,522.00	0.05
481	601858	中国科传	800	15,296.00	0.05
482	000031	大悦城	6,500	15,210.00	0.05
483	688153	唯捷创芯	400	14,800.00	0.05
484	688375	国博电子	200	14,128.00	0.04
485	601828	美凯龙	5,500	14,025.00	0.04
486	688819	天能股份	586	13,981.96	0.04
487	601158	重庆水务	2,900	13,920.00	0.04
488	002945	华林证券	1,300	12,974.00	0.04
489	688107	安路科技	500	12,710.00	0.04
490	600956	新天绿能	1,500	12,255.00	0.04
491	688348	昱能科技	200	11,800.00	0.04
492	688281	华秦科技	140	11,664.80	0.04
493	688295	中复神鹰	500	10,150.00	0.03

494	301165	锐捷网络	300	8,952.00	0.03
495	603868	飞科电器	200	7,680.00	0.02

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

注：本基金本报告期末未持有积极股票投资。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688777	中控技术	130,684.00	0.44
2	601567	三星医疗	123,546.00	0.42
3	601615	明阳智能	114,924.00	0.39
4	002202	金风科技	102,501.00	0.34
5	002436	兴森科技	95,509.00	0.32
6	301358	湖南裕能	93,017.00	0.31
7	603979	金诚信	91,634.00	0.31
8	300394	天孚通信	88,655.00	0.30
9	688617	惠泰医疗	88,348.00	0.30
10	000921	海信家电	87,430.00	0.29
11	300002	神州泰岳	87,047.00	0.29
12	300054	鼎龙股份	86,192.00	0.29
13	600872	中炬高新	82,803.00	0.28
14	300502	新易盛	82,382.00	0.28
15	603345	安井食品	81,185.00	0.27
16	002984	森麒麟	78,168.00	0.26
17	603179	新泉股份	71,896.00	0.24
18	603087	甘李药业	70,335.00	0.24
19	002422	科伦药业	67,710.00	0.23
20	688525	佰维存储	67,318.02	0.23

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002463	沪电股份	279,380.00	0.94
2	002422	科伦药业	236,945.00	0.80
3	000975	山金国际	191,639.00	0.64
4	600160	巨化股份	173,026.00	0.58
5	300418	昆仑万维	162,106.00	0.54
6	600161	天坛生物	148,683.00	0.50
7	600415	小商品城	126,080.00	0.42
8	688072	拓荆科技	125,210.55	0.42
9	600482	中国动力	112,979.00	0.38
10	300394	天孚通信	95,642.00	0.32
11	002600	领益智造	91,187.00	0.31
12	002131	利欧股份	58,152.00	0.20
13	601880	辽港股份	57,128.00	0.19
14	300502	新易盛	56,884.00	0.19
15	002032	苏泊尔	53,937.00	0.18
16	002966	苏州银行	53,860.00	0.18
17	688728	格科微	51,222.84	0.17
18	000581	威孚高科	50,291.00	0.17
19	002505	鹏都农牧	48,924.00	0.16
20	002092	ST中泰	48,814.00	0.16

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	11,012,672.81
卖出股票收入（成交）总额	8,035,006.80

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：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

注：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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

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 报告期内基金投资的前十名证券除思源电气股份有限公司,河南神火煤电股份有限公司,重庆农村商业银行股份有限公司外其他证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。中华人民共和国洋山港海事局2023年11月10日发布对思源电气股份有限公司的处罚(2023011000062011),中华人民共和国洋山港海事局2023年11月10日发布对思源电气股份有限公司的处罚(海事罚字[2023]011000062011),永城市水利局2024年05月14日发布对河南神火煤电股份有限公司的处罚(永水罚决字2024第2号),重庆市江北区市场监督管理局2023年09月27日发布对重庆农村商业银行股份有限公司的处罚(渝江北市监处字(2023)488号)。前述发行主体受到的处罚未影响其正常业务运作,上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的规定。

7.12.2 基金投资的前十名股票未超过基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	239,855.62
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	239,855.62

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有积极股票投资。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息**8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		国联中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
342	85,806.14	5,708,770.00	19.45%	3,374,930.00	11.50%	20,262,000.00	69.05%

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	BARCLAYS BANK PLC	2,938,000.00	10.01%
2	简街香港有限公司—JSQB有限公司（R）	2,768,170.00	9.43%
3	王道顺	500,000.00	1.70%

4	陈建仁	242,000.00	0.82%
5	古一鸣	175,000.00	0.60%
6	周京	136,300.00	0.46%
7	莫春风	113,300.00	0.39%
8	陈建慧	100,000.00	0.34%
9	陈新华	92,600.00	0.32%
10	张瑞娟	90,200.00	0.31%
-	中国光大银行股份有限公司—国联中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金	20,262,000.00	69.05%

注：1.本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人；
2.前十名持有人为除国联中证500ETF联接基金之外的前十名持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本报告期末，本基金基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金；
2、本基金基金经理未持有本开放式基金。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2019年11月15日)基金份额总额	235,345,700.00
本报告期期初基金份额总额	25,345,700.00
本报告期基金总申购份额	6,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	2,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	29,345,700.00

注：申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

本基金管理人于2024年4月10日发布公告，国联基金管理有限公司副总裁曹健先生转任公司督察长、公司督察长周妹云女士转任公司副总裁、刘鲁旦先生担任公司副总裁、马荣荣女士担任公司副总裁。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

无

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内管理人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数	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	

	量					
渤海证券	2	7,066,533.32	37.10%	5,271.38	37.11%	-
广发证券	2	11,981,146.29	62.90%	8,935.25	62.89%	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

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

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

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

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

注：本基金本报告期租用证券公司交易单元未进行其他证券投资。

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	国联基金管理有限公司关于办公地址名称变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-01-12
2	国联基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-04-10
3	国联基金管理有限公司高级	中国证监会指定报刊及网站	2024-04-10

	管理人员变更公告		
--	----------	--	--

§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
联接基金	1	20240101-20240630	20,662,000.00	20,396,700.00	20,796,700.00	20,262,000.00	69.05%

产品特有风险

本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，该类投资者大额赎回所持有的基金份额时，将可能产生流动性风险，即基金资产不能迅速变现，或者未能以合理的价格变现基金资产以支付投资者赎回款，对资产净值产生不利影响。

当开放式基金发生巨额赎回，基金管理人认为基金组合资产变现能力有限或认为因应对赎回导致的资产变现对基金单位份额净值产生较大的波动时，为了切实保护存量基金份额持有人的合法权益，可能出现延期支付赎回款等情形。同时为了公平对待所有投资者合法权益不受损害，管理人有权根据基金合同和招募说明书的约定，暂停或者拒绝申购、暂停赎回，基金份额持有人存在可能无法及时赎回持有的全部基金份额的风险。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

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

网址：<http://www.glfund.com/>

国联基金管理有限公司

二〇二四年八月三十日