

汇安中证 A500 指数证券投资基金

2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人:汇安基金管理有限责任公司

基金托管人:中国光大银行股份有限公司

送出日期:2026 年 03 月 31 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。本年度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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2026年3月30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。

本报告期自2025年1月24日起至2025年12月31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、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
§4 管理人报告.....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	18
4.9 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.....	18
§5 托管人报告.....	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
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.....	19
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	19
§6 审计报告.....	19
6.1 审计报告基本信息.....	19
6.2 审计报告的基本内容.....	19
§7 年度财务报表.....	22
7.1 资产负债表.....	22
7.2 利润表.....	24
7.3 净资产变动表.....	25
7.4 报表附注.....	26
§8 投资组合报告.....	54
8.1 期末基金资产组合情况.....	54
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	55
8.3 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.....	56
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	73
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	75
8.6 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.....	75
8.7 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.....	75
8.8 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.....	75

8.9 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	75
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	75
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	75
8.12 投资组合报告附注.....	75
§9 基金份额持有人信息	77
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	77
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	77
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	77
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	78
§10 开放式基金份额变动	78
§11 重大事件揭示.....	79
11.1 基金份额持有人大会决议	79
11.2 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	79
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	79
11.4 基金投资策略的改变	79
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	79
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	79
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	80
11.8 其他重大事件	81
§12 影响投资者决策的其他重要信息	82
12.1 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	82
§13 备查文件目录.....	82
13.1 备查文件目录.....	82
13.2 存放地点	83
13.3 查阅方式	83

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇安中证A500指数证券投资基金	
基金简称	汇安中证A500指数	
基金主代码	023038	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025年01月24日	
基金管理人	汇安基金管理有限责任公司	
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	29,720,580.46份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇安中证A500指数A	汇安中证A500指数C
下属分级基金的交易代码	023038	023039
报告期末下属分级基金的份额总额	5,505,009.29份	24,215,571.17份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用被动式指数化投资策略，紧密跟踪中证A500指数，力求实现对标的指数的跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金投资策略主要包括股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略等。
业绩比较基准	中证A500指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

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	汇安基金管理有限责任公司	中国光大银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	郭冬青	王茵
	联系电话	010-56711600	010-63639180
	电子邮箱	guodq@huanfund.cn	wangyin@cebbank.com
客户服务电话		010-56711690	95595
传真		010-56711640	010-63639132
注册地址		上海市虹口区欧阳路218弄1号2楼215室	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		北京市东城区东直门南大街5号中青旅大厦13层；上海市虹口区东大名路501号白玉兰大厦36层	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码		100007	100033
法定代表人		刘强	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	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.huanfund.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人办公地点

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	容诚会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市西城区阜成门外大街22号1幢10层1001-1至1001-26
注册登记机构	汇安基金管理有限责任公司	上海市虹口区东大名路501号上海白玉兰广场36层02单元

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	本期2025年01月24日（基金合同生效日） - 2025年12月31日	
	汇安中证A500指数 A	汇安中证A500指数 C
本期已实现收益	482,996.01	4,292,148.40
本期利润	619,255.80	8,758,026.65
加权平均基金份额本期利润	0.1193	0.1211
本期加权平均净值利润率	11.23%	11.81%
本期基金份额净值增长率	22.31%	22.02%
3.1.2 期末数据和指标	2025年末	
期末可供分配利润	671,947.67	2,889,936.29
期末可供分配基金份额利润	0.1221	0.1193
期末基金资产净值	6,733,208.02	29,548,941.58
期末基金份额净值	1.2231	1.2202
3.1.3 累计期末指标	2025年末	
基金份额累计净值增长率	22.31%	22.02%

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、对期末可供分配利润，采用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余额的孰低数。

4、基金合同生效日为2025年1月24日，至本报告期末，本基金合同生效未满一年。

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

汇安中证A500指数A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④

过去三个月	0.63%	0.99%	0.43%	1.00%	0.20%	-0.01%
过去六个月	21.05%	0.94%	20.71%	0.95%	0.34%	-0.01%
自基金合同生效起至今	22.31%	0.88%	25.03%	0.99%	-2.72%	-0.11%

汇安中证A500指数C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.57%	0.98%	0.43%	1.00%	0.14%	-0.02%
过去六个月	20.90%	0.94%	20.71%	0.95%	0.19%	-0.01%
自基金合同生效起至今	22.02%	0.88%	25.03%	0.99%	-3.01%	-0.11%

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

汇安中证A500指数A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2025年01月24日-2025年12月31日)



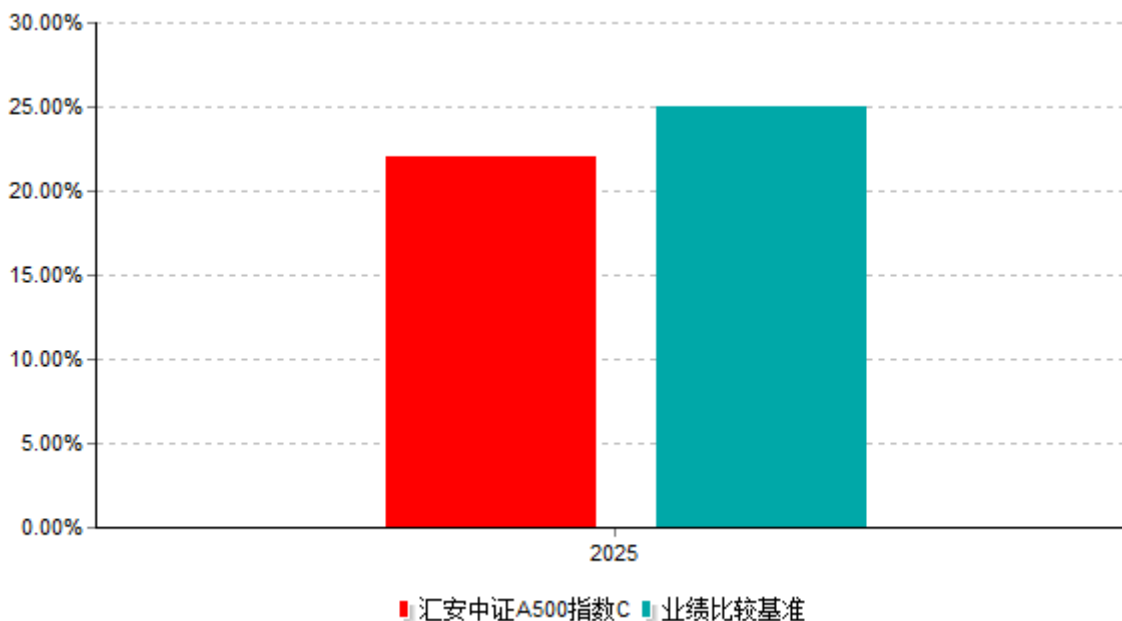
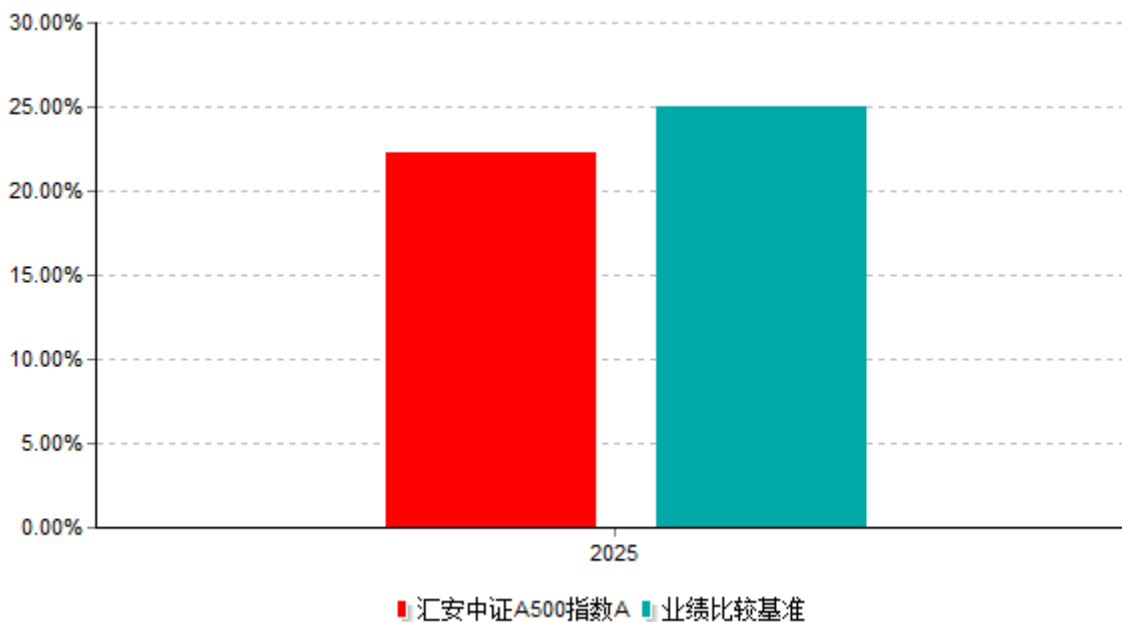
汇安中证A500指数C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2025年01月24日-2025年12月31日)



注：①基金合同生效日为2025年1月24日，至本报告期末，本基金合同生效未满一年。

②根据《汇安中证A500指数证券投资基金基金合同》的规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股（含存托凭证，下同）、国内依法发行上市的股票（包含主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、国内依法发行上市的债券（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债券、政府支持机构债券、政府支持债券等）、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、资产支持证券、国债期货、股指期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金根据相关法律法规可以参与融资及转融通证券出借业务。基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%且不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；股指期货、国债期货、股票期权及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。根据基金合同的规定，自基金合同生效之日起6个月内基金各项资产配置比例需符合基金合同要求。截至本报告期末，本基金已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年。本基金建仓期为2025年1月24日至2025年7月23日，建仓结束时各项资产比例符合合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同生效日为2025年1月24日。合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年来未进行过利润分配。

§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

本基金管理人为汇安基金管理有限责任公司，于2016年4月19日获中国证监会批复，2016年4月25日正式成立，是业内首家全自然人、由内部核心专业人士控股的公募基金基金管理公司，注册资本1亿元人民币，注册地为上海市，设北京、上海双总部。公司目前具有公开募集证券投资基金管理、基金销售、特定客户资产管理的资格。

截至2025年12月31日，公司旗下管理71只公募基金：

汇安丰融灵活配置混合型证券投资基金

汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金

汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金

汇安嘉源纯债债券型证券投资基金

汇安丰利灵活配置混合型证券投资基金

汇安丰泽灵活配置混合型证券投资基金

汇安沪深300指数增强型证券投资基金

汇安嘉裕纯债债券型证券投资基金

汇安多策略灵活配置混合型证券投资基金

汇安资产轮动灵活配置混合型证券投资基金

汇安裕华纯债定期开放债券型发起式证券投资基金

汇安成长优选灵活配置混合型证券投资基金

汇安稳裕债券型证券投资基金

汇安趋势动力股票型证券投资基金

汇安量化优选灵活配置混合型证券投资基金

汇安裕阳三年持有期混合型证券投资基金

汇安短债债券型证券投资基金

汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金

富时中国A50交易型开放式指数证券投资基金

汇安核心成长混合型证券投资基金

汇安鼎利纯债债券型证券投资基金

汇安多因子混合型证券投资基金

汇安行业龙头混合型证券投资基金

汇安中短债债券型证券投资基金

汇安嘉诚债券型证券投资基金

汇安量化先锋混合型证券投资基金

汇安中债-广西壮族自治区公司信用类债券指数证券投资基金

汇安宜创量化精选混合型证券投资基金
汇安嘉盛纯债债券型证券投资基金
汇安信利债券型证券投资基金
汇安裕和纯债债券型证券投资基金
汇安上证证券交易型开放式指数证券投资基金
汇安嘉利混合型证券投资基金
汇安核心资产混合型证券投资基金
汇安裕鑫12个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金
汇安价值蓝筹混合型证券投资基金
汇安消费龙头混合型证券投资基金
汇安恒鑫12个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金
汇安中证500指数增强型证券投资基金
汇安泓阳三年持有期混合型证券投资基金
汇安恒利39个月定期开放纯债债券型证券投资基金
汇安盛鑫三年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金
汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金
汇安均衡优选混合型证券投资基金
汇安核心价值混合型证券投资基金
汇安鑫利优选混合型证券投资基金
汇安泓利一年持有期混合型证券投资基金
汇安鑫泽稳健一年持有期混合型证券投资基金
汇安信泰稳健一年持有期混合型证券投资基金
汇安优势企业精选混合型证券投资基金
汇安永利30天持有期短债债券型证券投资基金
汇安润阳三年持有期混合型证券投资基金
汇安永福90天持有期中短债债券型证券投资基金
汇安裕同纯债债券型证券投资基金
汇安添利18个月持有期混合型证券投资基金
汇安远见成长混合型证券投资基金
汇安品质优选混合型证券投资基金
汇安价值先锋混合型证券投资基金
汇安裕盈纯债债券型证券投资基金
汇安裕泰纯债债券型证券投资基金
汇安中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金
汇安均衡成长混合型证券投资基金

汇安行业优选混合型证券投资基金
 汇安中债0-3年政策性金融债指数证券投资基金
 汇安景气成长混合型证券投资基金
 汇安中证A500指数证券投资基金
 汇安裕宏利率债债券型证券投资基金
 汇安聚利债券型证券投资基金
 汇安质选增利债券型证券投资基金
 汇安中证红利低波动100指数型证券投资基金
 汇安成长领航混合型证券投资基金

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金 经理（助理） 期限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
陈思余	策略量化组基金经 理、本基金的基金经 理	2025- 01-24	-	9年	陈思余先生，南开大学信息安全与法学双学位学士，9年证券、基金行业从业经验。历任天源迪科信息技术股份有限公司计费产品一部JAVA开发工程师。2017年4月加入汇安基金管理有限责任公司，担任策略量化组基金经理。2023年10月25日至2024年11月14日，任汇安量化先锋混合型证券投资基金基金经理；2023年10月25日至今，任汇安上证证券交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2023年10月25日至今，任富时中国A50交易型开放式指数证券投资基金基金经理；20

					25年1月24日至今，任汇安中证A500指数证券投资基金基金经理；2025年10月10日至今，任汇安趋势动力股票型证券投资基金基金经理；2025年12月22日至今，任汇安核心成长混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

- 1、“任职日期”和“离职日期”分别指根据公司对外披露的聘任日期和解聘日期。
- 2、证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。
- 3、本基金无基金经理助理。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金管理人旗下基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的，不存在基金经理薪酬激励与其在私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩挂钩的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《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，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求利益，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 公平交易制度和控制方法

公司严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善了公司公平交易制度，制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、监控等投资管理活动相关的各个环节，形成了有效的公平交易执行体系。

对于场内交易，公司启用了交易系统内的公平交易程序，在指令分发及指令执行阶段，均由系统强制执行公平委托；此外，公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易。对于场外交易，公司完善银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易的交易分配制度，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公

开发股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，完善相应制度及流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，确保公平交易原则的实现。基金管理人公平对待旗下管理的所有投资组合，报告期内公平交易制度得到良好的贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的情况。

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。本报告期内，本基金未发现可能的异常交易情况，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成交量超过该证券当日成交量的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

中国经济在2025年依然延续“弱复苏+结构升级”的运行特征。总量层面增长速率依然保持有5%，新动能领域持续扩张，经济结构改善成为全年主线。

首先在需求端方面，居民消费以服务消费修复为主；制造业投资呈现明显分化，高端制造、数字经济与绿色能源相关投资维持高景气，传统地产行业的需求边际影响趋于稳定。工业品价格低位运行，工业品供需修复仍需时间，另一边，居民消费价格保持温和区间。金融数据方面，社融增速总体已趋于稳定。信贷投向更多集中于政策重点领域，信用结构改善效果显现。整体供需关系结构不断优化。

再者货币政策方面，人民币保持流动性合理充裕，政策重点支持科技创新、绿色转型与中小企业融资需求。专项资金持续向先进制造、数字基础设施与能源转型领域集中，以支持经济转型的需要。产业政策层面，“新质生产力”成为核心关键词，科技自主可控、高端制造与产业链安全构成中长期政策主线。

整体来看，过去一年国内经济处于周期底部区域的修复阶段，经济的韧性有着产业升级与政策托底，新质生产力为国内经济发展提供了更强的动能，为经济转型贡献更多的力量。

放眼全球，经济外部环境的不确定性成为全球经济的重要变量。地缘政治博弈的不稳定、全球范围的贸易摩擦与产业链重构持续推进。虽然美联储全年以来连续三次降息，核心通胀和服务业通胀仍然没有降低，美元信用边际的弱化也在持续加深。欧洲经济延续低增长格局，复苏弹性依然受制于能源价格较高与产业竞争力不足的问题。新兴市场经济体受美元货币政策影响承受资本流动压力。全球大部分央行的储备多元化配置的加速导致黄金在全球储备中的地位提升，形成结构性需求，最终体现为黄金全年的强势表现。同时受益于全球高端制造的火热带来的结构性需求，有色金属为代表的资源资产也逐步纳入了“长期配置资产”的框架下。整体来看风险资产定价从“成长溢价”转向“质量溢价”。

过去一年中证A500指数在全年运行中体现出较强的产业成长属性，与先进制造、医药生物、科技创新等高景气方向形成共振，成为结构性行情的重要承载指数。

年国内经济从传统动能向新质生产力转型，中小市值企业在高端制造、数字经济与医疗创新领域的技术突破与市场拓展持续推进，盈利增速整体优于大盘权重板块，指数基本面支撑逐步强化。

同步看估值侧，我们认为中证A500指数在全年大部分时间维持相对合理区间，与大盘蓝筹指数相比仍具备一定估值优势。在风险偏好逐步修复、成长板块重新获得资金关注的背景下，指数的配置价值持续提升。

从政策环境看，2025年政策导向更强调创新驱动与中小企业发展。指数所代表的企业群体在政策与产业趋势的双重支持下，成长路径更加清晰。

整体而言，2025年中证A500指数产业升级受益显著、盈利成长性突出、估值具备安全边际，有望成为投资者把握中国经济结构转型的重要指数工具。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末汇安中证A500指数A基金份额净值为1.2231元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为22.31%，同期业绩比较基准收益率为25.03%；截至报告期末汇安中证A500指数C基金份额净值为1.2202元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为22.02%，同期业绩比较基准收益率为25.03%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026年中国经济的关键变量在于结构转型成果的逐步兑现。伴随高端制造、数字经济与绿色产业投资进入产出释放阶段，新动能对经济增长的贡献度有望加速提升。消费端在就业与收入预期改善后或许有较强的修复潜力，整体节奏预期依然以稳为主，地产与传统基建对经济的拖累预计进一步减弱。综合来看，经济增长模式将更多依赖科技创新、产业升级与新技术带来的效率提升。

宏观政策预计维持稳健取向，在防风险与稳增长之间寻求动态平衡，强调长期可持续性。2026年资本市场更可能呈现结构性行情：科技制造、高端装备与数字产业链在一定程度上成为了中长期配置的主线；具备稳定现金流与股东回报能力的红利资产具备防御与配置价值；债券资产在波动阶段仍承担组合稳定器功能；商品与贵金属更多体现对冲属性。市场逻辑将继续围绕基本面、产业趋势与政策方向展开，而非仅仅流动性驱动。

此外，投资环境将可能从“防风险阶段”转向“寻找确定性收益阶段”，因此控制波动与回撤、强化结构性配置、以中长期视角布局产业趋势将是未来一年资产配置的关键。这同样意味着，超额收益将可能更多来自行业选择与资产配置效率，而非单一宏观贝塔驱动。

放眼全球，同期全球经济可能进入高利率周期后的再平衡阶段，金融条件或许可能会受益于美联储降息带来的边际改善，但是财政赤字高企、地缘政治摩擦与产业政策竞争又将持续抬升长期不确定性，全球增长中枢后续仍然可能难以达到过去十年平均水平。

就宽基指数而言，中证A500指数仍具备较强的结构性成长潜力。随着产业集中度提升与竞争格局优化，优质成长企业的盈利能力预计持续增强。未来一年中证A500指数的长期成长属性仍是核心支撑。

本基金管理人后续将严格跟踪中证A500指数，努力将跟踪偏离度与跟踪误差控制在合理区间。基金运作将持续坚持纪律化管理，在确保指数复制效率的同时兼顾流动性与成本控制，力求帮助投资者长期分享中国经济高质量发展的成果。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人依照法律法规和公司内部控制的整体要求，致力于内控机制的完善，积极推动主动合规管理；全面加强风险控制，不断提高风险控制水平；有计划地开展监察稽核工作，推动公司内控体系和制度措施的落实，强化对基金投资运作和公司经营管理的合规性管理。

本报告期内，本基金管理人结合新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展情况，坚持从保障基金持有人利益出发，由督察长领导独立于各业务部门的合规风控部不断推动完善相关制度流程的建立、健全，及时贯彻落实新的监管要求，并通过实时监控、定期检查、专项检查等方式深入开展监察稽核工作，包括对基金投资运作、基金投资交易、基金销售与宣传、投资者适当性管理、客户服务、产品开发、信息披露、反洗钱工作、信息系统与信息安全和基金运营等方面进行监察稽核，及时发现上述业务开展中的相关问题，提出改进建议并跟踪改进落实情况。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全内部管理制度，不断提高监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，切实保护基金份额持有人的利益。

4.7 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。

本基金管理人设有估值委员会，公司运营总监担任估值委员会主席，投资部门、合规风控部和运营部指定人员担任委员。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未发生利润分配情况。

4.9 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

自2025年7月25日起至本报告期末，本基金连续超过六十个工作日基金资产净值低于五千万元，本基金管理人已按法规要求向证监会报送解决方案。2025年1月24日至2025年7月24日，本基金未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。为减轻基金固定费用支出给投资者造成的负担，切实保障基金份额持有人利益，2025年10月25日至本报告期末由基金管理人承担本基金相关固定费用（包括审计费、信息披露费等）。

§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汇安中证A500指数证券投资基金（以下简称“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 托管人对本年度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《汇安中证A500指数证券投资基金2025年年度报告》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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	容诚审字[2026]200Z0903号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	汇安中证A500指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了汇安中证A500指数证券投资基金（以下简称“汇安中证A500指数基金”）财务报表，包括2025年12月31日的资产负债表，2025年1月24日（基金合同生效日）至2025年12月31日止期

	<p>间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“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，公允反映了汇安中证A500指数基金2025年12月31日的财务状况以及2025年1月24日（基金合同生效日）至2025年12月31日止期间的经营成果和净资产变动情况。</p>
<p>形成审计意见的基础</p>	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则和中国注册会计师独立性准则，我们独立于汇安中证A500指数基金，并遵守了独立性准则中适用于公众利益实体财务报表审计的规定，同时履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
<p>强调事项</p>	<p>不适用</p>
<p>其他事项</p>	<p>不适用</p>
<p>其他信息</p>	<p>不适用</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>汇安中证A500指数基金的基金管理人汇安基金管理有限责任公司（以下简称“基金管理人”）管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估汇安中证A500指数基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经</p>

	<p>营假设，除非基金管理人管理层计划清算汇安中证A500指数基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督汇安中证A500指数基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对汇安中证A500指数基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如</p>

	<p>果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致汇安中证A500指数基金不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	张振波	张碧佳
会计师事务所的地址	北京市西城区阜成门外大街22号1幢10层1001-1至1001-26	
审计报告日期	2026-03-27	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：汇安中证A500指数证券投资基金

报告截止日：2025年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025年12月31日
资产：		
货币资金	7.4.7.1	2,515,437.64
结算备付金		190.62
存出保证金		23,681.55
交易性金融资产	7.4.7.2	34,335,491.93
其中：股票投资		34,335,491.93
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	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收清算款		315,728.90
应收股利		-
应收申购款		29,884.56
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.5	-
资产总计		37,220,415.20
负债和净资产	附注号	本期末 2025年12月31日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		754,526.93
应付管理人报酬		16,135.89
应付托管费		3,227.18
应付销售服务费		6,636.86
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	7.4.7.6	157,738.74
负债合计		938,265.60
净资产：		
实收基金	7.4.7.7	29,720,580.46

未分配利润	7.4.7.8	6,561,569.14
净资产合计		36,282,149.60
负债和净资产总计		37,220,415.20

注：1.报告截止日2025年12月31日，基金份额总额29,720,580.46份，其中汇安中证A500指数A基金份额净值1.2231元，份额总额5,505,009.29份；汇安中证A500指数C基金份额净值1.2202元，份额总额24,215,571.17份。

2.本财务报表的实际编制期间为2025年1月24日(基金合同生效日)至2025年12月31日止期间。

7.2 利润表

会计主体：汇安中证A500指数证券投资基金

本报告期：2025年01月24日（基金合同生效日）至2025年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025年01月24日（基金合同 生效日）至2025年12月31 日
一、营业总收入		10,172,135.05
1.利息收入		206,918.37
其中：存款利息收入	7.4.7.9	143,305.80
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		63,612.57
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		5,362,034.67
其中：股票投资收益	7.4.7.10	3,941,593.90
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.11	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	1,420,440.77

其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	4,602,138.04
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	1,043.97
减：二、营业总支出		794,852.60
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	384,487.80
2.托管费	7.4.10.2.2	76,897.59
3.销售服务费	7.4.10.2.3	179,240.87
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		-
7.税金及附加		-
8.其他费用	7.4.7.18	154,226.34
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,377,282.45
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,377,282.45
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		9,377,282.45

7.3 净资产变动表

会计主体：汇安中证A500指数证券投资基金

本报告期：2025年01月24日（基金合同生效日）至2025年12月31日

单位：人民币元

项目	本期		
	2025年01月24日（基金合同生效日）至2025年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-

二、本期期初净资产	222,952,890.05	-	222,952,890.05
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-193,232,309.59	6,561,569.14	-186,670,740.45
（一）、综合收益总额	-	9,377,282.45	9,377,282.45
（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）	-193,232,309.59	-2,815,713.31	-196,048,022.90
其中：1.基金申购款	27,166,540.67	3,554,011.19	30,720,551.86
2.基金赎回款	-220,398,850.26	-6,369,724.50	-226,768,574.76
（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	29,720,580.46	6,561,569.14	36,282,149.60

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

刘强

王嘉浩

江士

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

汇安中证A500指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2024]1811号《关于准予汇安中证A500指数证券投资基金注册的批复》注册，由汇安基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投

资基金法》和《汇安中证A500指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，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222,905,833.65元，业经容诚会计师事务所(特殊普通合伙)容诚验字[2025]200Z0019号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《汇安中证A500指数证券投资基金基金合同》于2025年1月24日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额222,952,890.05份基金份额，其中认购资金利息折合47,056.40份基金份额。本基金的基金管理人为汇安基金管理有限责任公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《汇安中证A500指数证券投资基金基金合同》和《汇安中证A500指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据认购费/申购费及销售服务费收取方式的不同将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购基金时收取认购/申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费，并在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为C类基金份额。本基金A类和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间的转换规定请见相关公告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇安中证A500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具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股（含存托凭证，下同）、国内依法发行上市的股票（包含主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、国内依法发行上市的债券（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债券、政府支持机构债券、政府支持债券等）、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、资产支持证券、国债期货、股指期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金根据相关法律法规可以参与融资及转融通证券出借业务。本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%且不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；股指期货、国债期货、股票期权及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：中证A500指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人汇安基金管理有限责任公司于2026年3月27日批准报出。

7.4.2 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》、《汇安中证A500指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续60个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5,000万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于2025年12月31日，本基金出现连续60个工作日基金资产净值低于5,000万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案，故本财务报表仍以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2025年1月24日（基金合同生效日）至2025年12月31日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2025年12月31日的财务状况以及2025年1月24日（基金合同生效日）至2025年12月31日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2025年1月24日（基金合同生效日）至2025年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产

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

债务工具

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

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

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

(2) 金融负债

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

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不

满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种, 根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外), 按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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》、财政部、国家税务总局公告2025年第4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关境内外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，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自2025年8月8日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在2025年8月8日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。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。

(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。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日
活期存款	2,515,437.64
等于：本金	2,515,168.12
加：应计利息	269.52
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	2,515,437.64

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	29,733,353.89	-	34,335,491.93	4,602,138.04
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	29,733,353.89	-	34,335,491.93	4,602,138.04

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 其他资产

无。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31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	3,912.40
其中：交易所市场	3,912.40
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	33,649.94
预提费用-信息披露费	120,176.40
合计	157,738.74

7.4.7.7 实收基金

7.4.7.7.1 汇安中证A500指数A

金额单位：人民币元

项目 (汇安中证A500指数A)	本期 2025年01月24日（基金合同生效日）至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	12,048,516.92	12,048,516.92
本期申购	9,162,821.92	9,162,821.92
本期赎回（以“-”号填列）	-15,706,329.55	-15,706,329.55

本期末	5,505,009.29	5,505,009.29
-----	--------------	--------------

7.4.7.7.2 汇安中证A500指数C

金额单位：人民币元

项目 (汇安中证A500指数C)	本期 2025年01月24日（基金合同生效日）至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	210,904,373.13	210,904,373.13
本期申购	18,003,718.75	18,003,718.75
本期赎回（以“-”号填列）	-204,692,520.71	-204,692,520.71
本期末	24,215,571.17	24,215,571.17

注：1. 申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 本基金自2024年12月24日至2025年1月21日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币222,905,833.65元，折合为222,905,833.65份基金份额(其中A类基金份额12,045,372.58份，C类基金份额210,860,461.07份)。根据《汇安中证A500指数证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币47,056.40元在本基金成立后，折合为47,056.40份基金份额(其中A类基金份额3,144.34份，C类基金份额43,912.06份)，划入基金份额持有人账户。

3. 根据《汇安中证A500指数证券投资基金基金合同》、《汇安中证A500指数证券投资基金招募说明书》及《汇安中证A500指数证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告》的相关规定，本基金于2025年1月24日(基金合同生效日)至2025年2月23日止期间暂不向投资人开放基金交易，申购业务、赎回业务、转换业务及定期定额投资业务自2025年2月24日起开始办理。

7.4.7.8 未分配利润

7.4.7.8.1 汇安中证A500指数A

单位：人民币元

项目 (汇安中证A500指数A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	482,996.01	136,259.79	619,255.80

本期基金份额交易产生的变动数	188,951.66	419,991.27	608,942.93
其中：基金申购款	628,008.80	1,034,836.45	1,662,845.25
基金赎回款	-439,057.14	-614,845.18	-1,053,902.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	671,947.67	556,251.06	1,228,198.73

7.4.7.8.2 汇安中证A500指数C

单位：人民币元

项目 (汇安中证A500指数C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	4,292,148.40	4,465,878.25	8,758,026.65
本期基金份额交易产生的变动数	-1,402,212.11	-2,022,444.13	-3,424,656.24
其中：基金申购款	770,597.04	1,120,568.90	1,891,165.94
基金赎回款	-2,172,809.15	-3,143,013.03	-5,315,822.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,889,936.29	2,443,434.12	5,333,370.41

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月24日（基金合同生效日）至2025年12月31日
活期存款利息收入	122,360.32
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	20,643.70
其他	301.78
合计	143,305.80

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 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01月24日（基金合同生效日）至2025年12月31日
卖出股票成交总额	83,878,980.46
减：卖出股票成本总额	79,847,178.46
减：交易费用	90,208.10
买卖股票差价收入	3,941,593.90

7.4.7.10.2 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

无。

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

7.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

7.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.13 贵金属投资收益

7.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月24日（基金合同生效日）至2025年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,420,440.77
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	1,420,440.77

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025年01月24日（基金合同生效日）至2025年12月31日
1.交易性金融资产	4,602,138.04
——股票投资	4,602,138.04
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	4,602,138.04

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年01月24日（基金合同生效日）至2025年12月31日
基金赎回费收入	287.94
转换费收入	756.03
合计	1,043.97

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2025年01月24日（基金合同生效日）至2025年12月31日
审计费用	33,649.94
信息披露费	120,176.40
证券出借违约金	-
开户费	400.00
合计	154,226.34

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
汇安基金管理有限责任公司	基金管理人、基金登记机构、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
何斌	基金管理人的股东
秦军	基金管理人的股东
郭小峰	基金管理人的股东
任建辉	基金管理人的股东
刘强	基金管理人的股东
郭兆强	基金管理人的股东
尹喜杰	基金管理人的股东
王福德	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

无。

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

无。

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月24日（基金合同生效日）至2025年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	384,487.80
其中：应支付销售机构的客户维护费	189,027.22
应支付基金管理人的净管理费	195,460.58

注：支付基金管理人汇安基金管理有限责任公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.50% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月24日（基金合同生效日）至2025年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	76,897.59

注：支付基金托管人中国光大银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2025年01月24日（基金合同生效日）至2025年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇安中证A500指数A	汇安中证A500指数C	合计
中国光大银行股份有限公司	0.00	177,117.28	177,117.28
汇安基金管理有限责任公司	0.00	863.21	863.21
合计	-	177,980.49	177,980.49

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给汇安基金管理有限责任公司，再由汇安基金管理有限责任公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日C类基金份额的基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 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

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

无。

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

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

汇安中证A500指数C

份额单位：份

项目	本期
	2025年01月24日（基金合同生效日）至2025年12月31日
基金合同生效日（2025年01月24日）持有的基金份额	-
报告期初持有的基金份额	-
报告期间申购/买入总份额	876,438.09
报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	876,438.09
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.62%

注：

1.基金管理人汇安基金管理有限责任公司投资本基金适用的认（申）购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

2.报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例，比例的分母分别采用各自级别的份额总额计算。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.6 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01月24日（基金合同生效日）至2025年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国光大银行股份有限公司	2,515,437.64	122,360.32

注：本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于本报告期内，基金管理人自主承担本基金部分信息披露费和审计费等固定费用。

7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金之外的基金

无。

7.4.12 期末（2025年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002049	紫光国微	2025-12-30	重大事项	78.81	2026-01-15	86.69	700	49,658.45	55,167.00	-
688012	中微公司	2025-12-19	拟筹划重大资产	283.76	2026-01-05	278.00	645	147,698.65	183,025.20	-

			重 组							
--	--	--	--------	--	--	--	--	--	--	--

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，其风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。

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，通过管理及信息系统持续监控上述各类风险。

公司建立董事会领导下的风险管理体系，包括董事会的下设的风险控制委员会、总经理下设的风险管理委员会、督察长、合规风控部以及各个业务部门组成。

公司致力于实行全面、系统的风险管理，通过制定系统化的风险管理程序，对风险管理的整个流程进行评估和改进。公司奉行分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，构建由四大防线共同筑成的风险管理体系：第一道防线由各个业务部门构成，各业务部门总监作为风险责任人；第二道监控防线由合规风控部构成，对公司运营过程中产生的或潜在的各项风险进行有效管理，并就内部控制及风险管理制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能；第三道防线是由总经理及其下设的风险管理委员会构成，总经理负责公司日常经营管理中的风险管理工作。总经理下设风险管理委员会，负责对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和防控；第四道监控防线由董事会及其下设公司风险控制委员会构成。董事会负责公司整体风险的预防和控制，审核、监督公司风险管理制度的有效执行。董事会下设公司风险控制委员会，协助董事会确立公司风险取向，风险总量、风险限额，制定和调整公司风险管理战略、原则、政策和指导方针，并确保其得到有效执行。

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，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。

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国光大银行股份有限公司，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，违约可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于2025年12月31日，本基金无债券投资或资产支持证券投资。

7.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日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。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。

于2025年12月31日，本基金所承担的全部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，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度

指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间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。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10% (完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

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，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于2025年12月31日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025年 12月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,515,437.64	-	-	-	2,515,437.64
结算备付金	190.62	-	-	-	190.62
存出保证金	23,681.55	-	-	-	23,681.55
交易性金融资产	-	-	-	34,335,491.93	34,335,491.93
应收清算款	-	-	-	315,728.90	315,728.90
应收申购款	-	-	-	29,884.56	29,884.56
资产总计	2,539,309.81	-	-	34,681,105.39	37,220,415.20
负债					
应付赎回款	-	-	-	754,526.93	754,526.93
应付管理人报酬	-	-	-	16,135.89	16,135.89

应付托管费	-	-	-	3,227.18	3,227.18
应付销售服务费	-	-	-	6,636.86	6,636.86
其他负债	-	-	-	157,738.74	157,738.74
负债总计	-	-	-	938,265.60	938,265.60
利率敏感度缺口	2,539,309.81	-	-	33,742,839.79	36,282,149.60

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数成分股组成及其权重构建投资组合，并根据标的指数成分股及其权重的变动进行相应调整。

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	34,335,491.93	94.63
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	34,335,491.93	94.63

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证A500指数以外的其他变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2025年12月31日
	中证A500指数上升5%	1,862,019.71
	中证A500指数下降5%	-1,862,019.71

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2025年12月31日
第一层次	34,097,299.73
第二层次	238,192.20
第三层次	-
合计	34,335,491.93

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2025年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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。

§8 投资组合报告

8.1 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	34,335,491.93	92.25
	其中：股票	34,335,491.93	92.25
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	2,515,628.26	6.76
8	其他各项资产	369,295.01	0.99
9	合计	37,220,415.20	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	175,896.00	0.48
B	采矿业	1,965,508.10	5.42
C	制造业	21,624,851.49	59.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	844,518.00	2.33
E	建筑业	535,646.00	1.48
F	批发和零售业	231,146.00	0.64
G	交通运输、仓储和邮政业	969,019.00	2.67
H	住宿和餐饮业	28,562.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,003,075.34	5.52

J	金融业	4,588,374.00	12.65
K	房地产业	298,421.00	0.82
L	租赁和商务服务业	376,053.00	1.04
M	科学研究和技术服务业	381,435.00	1.05
N	水利、环境和公共设施管理业	81,182.00	0.22
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	21,372.00	0.06
Q	卫生和社会工作	103,000.00	0.28
R	文化、体育和娱乐业	67,059.00	0.18
S	综合	40,374.00	0.11
	合计	34,335,491.93	94.63

8.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

8.2.3 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持有港股通股票。

8.3 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

8.3.1 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	300750	宁德时代	3,100	1,138,506.00	3.14
2	600519	贵州茅台	700	964,026.00	2.66
3	601318	中国平安	12,400	848,160.00	2.34
4	300308	中际旭创	1,300	793,000.00	2.19
5	601899	紫金矿业	19,100	658,377.00	1.81
6	600036	招商银行	14,400	606,240.00	1.67

7	300502	新易盛	1,160	499,820.80	1.38
8	000333	美的集团	5,700	445,455.00	1.23
9	601166	兴业银行	19,700	414,882.00	1.14
10	600900	长江电力	14,300	388,817.00	1.07
11	300059	东方财富	14,800	343,064.00	0.95
12	002475	立讯精密	5,900	334,589.00	0.92
13	600030	中信证券	11,400	327,294.00	0.90
14	688981	中芯国际	2,554	313,707.82	0.86
15	002594	比亚迪	3,200	312,704.00	0.86
16	600276	恒瑞医药	5,200	309,764.00	0.85
17	601398	工商银行	37,800	299,754.00	0.83
18	300274	阳光电源	1,700	290,768.00	0.80
19	688041	海光信息	1,275	286,122.75	0.79
20	688256	寒武纪	200	271,110.00	0.75
21	601211	国泰海通	13,100	269,205.00	0.74
22	603259	药明康德	2,900	262,856.00	0.72
23	601288	农业银行	33,800	259,584.00	0.72
24	000858	五粮液	2,300	243,662.00	0.67
25	601328	交通银行	31,400	227,650.00	0.63
26	002371	北方华创	485	222,653.80	0.61
27	000651	格力电器	5,300	213,166.00	0.59
28	600887	伊利股份	7,400	211,640.00	0.58
29	603993	洛阳钼业	10,300	206,000.00	0.57
30	300476	胜宏科技	700	201,306.00	0.55
31	600000	浦发银行	15,700	195,308.00	0.54
32	688012	中微公司	645	183,025.20	0.50
33	600150	中国船舶	5,344	177,741.44	0.49
34	000725	京东方A	41,900	176,399.00	0.49
35	601816	京沪高铁	33,600	173,040.00	0.48
36	603986	兆易创新	800	171,400.00	0.47
37	600309	万华化学	2,200	168,696.00	0.46

38	601601	中国太保	4,000	167,640.00	0.46
39	688008	澜起科技	1,416	166,804.80	0.46
40	300124	汇川技术	2,200	165,726.00	0.46
41	002714	牧原股份	3,200	161,856.00	0.45
42	601088	中国神华	3,900	157,950.00	0.44
43	600031	三一重工	7,000	147,910.00	0.41
44	603019	中科曙光	1,700	145,588.00	0.40
45	002050	三花智控	2,600	143,806.00	0.40
46	000063	中兴通讯	3,800	143,792.00	0.40
47	002230	科大讯飞	2,800	140,812.00	0.39
48	601857	中国石油	13,300	138,453.00	0.38
49	600111	北方稀土	2,900	133,748.00	0.37
50	300760	迈瑞医疗	700	133,315.00	0.37
51	600089	特变电工	5,900	131,098.00	0.36
52	000001	平安银行	11,400	130,074.00	0.36
53	601012	隆基绿能	7,100	129,220.00	0.36
54	002415	海康威视	4,300	128,312.00	0.35
55	002384	东山精密	1,500	126,975.00	0.35
56	603501	豪威集团	1,000	125,900.00	0.35
57	601668	中国建筑	24,300	124,659.00	0.34
58	000425	徐工机械	10,700	123,906.00	0.34
59	600660	福耀玻璃	1,900	123,063.00	0.34
60	603799	华友钴业	1,800	122,868.00	0.34
61	002463	沪电股份	1,600	116,912.00	0.32
62	600690	海尔智家	4,400	114,796.00	0.32
63	300394	天孚通信	560	113,696.80	0.31
64	000338	潍柴动力	6,600	113,520.00	0.31
65	601728	中国电信	18,000	113,400.00	0.31
66	600941	中国移动	1,100	111,155.00	0.31
67	002352	顺丰控股	2,900	111,128.00	0.31
68	601919	中远海控	7,300	110,814.00	0.31

69	000792	盐湖股份	3,900	109,824.00	0.30
70	601127	赛力斯	900	108,864.00	0.30
71	601600	中国铝业	8,900	108,758.00	0.30
72	002028	思源电气	700	108,213.00	0.30
73	600406	国电南瑞	4,800	107,904.00	0.30
74	000100	TCL科技	23,300	105,782.00	0.29
75	000568	泸州老窖	900	104,598.00	0.29
76	601888	中国中免	1,100	104,016.00	0.29
77	600418	江淮汽车	2,100	103,950.00	0.29
78	600028	中国石化	16,300	100,734.00	0.28
79	600183	生益科技	1,400	99,974.00	0.28
80	000988	华工科技	1,200	95,196.00	0.26
81	601988	中国银行	16,600	95,118.00	0.26
82	601766	中国中车	13,600	92,752.00	0.26
83	300014	亿纬锂能	1,400	92,064.00	0.25
84	601225	陕西煤业	4,300	91,676.00	0.25
85	601628	中国人寿	2,000	91,000.00	0.25
86	600050	中国联通	17,500	89,425.00	0.25
87	002460	赣锋锂业	1,400	88,046.00	0.24
88	002625	光启技术	1,800	87,768.00	0.24
89	002027	分众传媒	11,900	87,703.00	0.24
90	000807	云铝股份	2,600	85,384.00	0.24
91	600547	山东黄金	2,200	85,162.00	0.23
92	600938	中国海油	2,800	84,504.00	0.23
93	601985	中国核电	9,700	83,905.00	0.23
94	002241	歌尔股份	2,900	83,317.00	0.23
95	600104	上汽集团	5,300	80,666.00	0.22
96	000977	浪潮信息	1,200	79,920.00	0.22
97	002916	深南电路	340	78,978.60	0.22
98	002709	天赐材料	1,700	78,761.00	0.22
99	601689	拓普集团	1,000	77,180.00	0.21

100	601006	大秦铁路	14,800	76,368.00	0.21
101	000408	藏格矿业	900	75,960.00	0.21
102	300433	蓝思科技	2,500	75,675.00	0.21
103	600019	宝钢股份	10,100	75,245.00	0.21
104	002837	英维克	700	74,823.00	0.21
105	600489	中金黄金	3,200	74,752.00	0.21
106	601658	邮储银行	13,600	74,120.00	0.20
107	603288	海天味业	2,000	74,040.00	0.20
108	002558	巨人网络	1,700	73,593.00	0.20
109	300408	三环集团	1,600	73,200.00	0.20
110	600905	三峡能源	17,700	72,393.00	0.20
111	000625	长安汽车	6,100	72,346.00	0.20
112	002466	天齐锂业	1,300	71,994.00	0.20
113	002738	中矿资源	900	70,695.00	0.19
114	600879	航天电子	3,300	70,356.00	0.19
115	688271	联影医疗	556	69,778.00	0.19
116	600438	通威股份	3,400	69,768.00	0.19
117	601390	中国中铁	12,700	68,707.00	0.19
118	300136	信维通信	1,100	68,200.00	0.19
119	600436	片仔癀	400	67,512.00	0.19
120	601727	上海电气	7,800	67,158.00	0.19
121	600010	包钢股份	28,000	66,640.00	0.18
122	600118	中国卫星	700	66,465.00	0.18
123	600584	长电科技	1,800	66,204.00	0.18
124	688072	拓荆科技	200	66,000.00	0.18
125	601100	恒立液压	600	65,946.00	0.18
126	600160	巨化股份	1,700	65,314.00	0.18
127	300450	先导智能	1,300	64,974.00	0.18
128	300033	同花顺	200	64,436.00	0.18
129	000426	兴业银锡	1,800	64,080.00	0.18
130	600580	卧龙电驱	1,300	63,830.00	0.18

131	300015	爱尔眼科	5,800	63,684.00	0.18
132	000538	云南白药	1,100	62,436.00	0.17
133	600115	中国东航	10,400	62,400.00	0.17
134	000630	铜陵有色	10,300	61,903.00	0.17
135	600487	亨通光电	2,500	61,825.00	0.17
136	600522	中天科技	3,400	61,608.00	0.17
137	688111	金山办公	200	61,414.00	0.17
138	002202	金风科技	3,000	61,200.00	0.17
139	600362	江西铜业	1,100	60,412.00	0.17
140	600893	航发动力	1,500	60,045.00	0.17
141	600426	华鲁恒升	1,900	59,717.00	0.16
142	000938	紫光股份	2,400	59,040.00	0.16
143	600346	恒力石化	2,600	58,578.00	0.16
144	002532	天山铝业	3,600	58,248.00	0.16
145	601168	西部矿业	2,100	58,044.00	0.16
146	600570	恒生电子	1,900	57,285.00	0.16
147	600585	海螺水泥	2,600	56,836.00	0.16
148	002179	中航光电	1,600	56,704.00	0.16
149	002156	通富微电	1,500	56,550.00	0.16
150	600988	赤峰黄金	1,800	56,232.00	0.15
151	600760	中航沈飞	1,000	56,150.00	0.15
152	600066	宇通客车	1,700	55,590.00	0.15
153	600795	国电电力	11,000	55,440.00	0.15
154	002049	紫光国微	700	55,167.00	0.15
155	688521	芯原股份	400	54,788.00	0.15
156	601669	中国电建	10,500	54,600.00	0.15
157	000157	中联重科	6,300	54,369.00	0.15
158	688235	百济神州	200	53,720.00	0.15
159	605499	东鹏饮料	200	53,478.00	0.15
160	600549	厦门钨业	1,300	53,378.00	0.15
161	300442	润泽科技	1,000	52,800.00	0.15

162	600143	金发科技	2,700	52,758.00	0.15
163	600009	上海机场	1,600	52,416.00	0.14
164	300803	指南针	400	52,348.00	0.14
165	688036	传音控股	791	52,332.56	0.14
166	000933	神火股份	1,900	52,193.00	0.14
167	600176	中国巨石	3,000	51,300.00	0.14
168	600415	小商品城	3,200	51,040.00	0.14
169	600989	宝丰能源	2,600	51,038.00	0.14
170	002407	多氟多	1,500	50,865.00	0.14
171	002074	国轩高科	1,300	50,843.00	0.14
172	300604	长川科技	500	50,655.00	0.14
173	688126	沪硅产业	2,339	50,615.96	0.14
174	600029	南方航空	6,300	50,463.00	0.14
175	601058	赛轮轮胎	3,100	50,158.00	0.14
176	300395	菲利华	500	50,150.00	0.14
177	600096	云天化	1,500	50,115.00	0.14
178	300207	欣旺达	1,900	49,685.00	0.14
179	002353	杰瑞股份	700	49,581.00	0.14
180	000547	航天发展	1,500	49,515.00	0.14
181	300339	润和软件	1,000	49,500.00	0.14
182	600885	宏发股份	1,620	49,248.00	0.14
183	000975	山金国际	2,000	48,660.00	0.13
184	300058	蓝色光标	4,200	48,384.00	0.13
185	002195	岩山科技	6,800	48,212.00	0.13
186	600048	保利发展	7,600	46,360.00	0.13
187	002517	恺英网络	2,100	45,927.00	0.13
188	601360	三六零	4,100	45,797.00	0.13
189	002938	鹏鼎控股	900	45,522.00	0.13
190	688122	西部超导	608	45,344.64	0.12
191	002131	利欧股份	8,000	45,120.00	0.12
192	002851	麦格米特	500	45,035.00	0.12

193	600196	复星医药	1,700	45,033.00	0.12
194	002555	三七互娱	1,900	44,840.00	0.12
195	002436	兴森科技	2,100	44,457.00	0.12
196	002340	格林美	5,300	44,308.00	0.12
197	688120	华海清科	294	44,123.52	0.12
198	600219	南山铝业	8,200	44,116.00	0.12
199	601186	中国铁建	5,700	43,719.00	0.12
200	600839	四川长虹	4,800	43,680.00	0.12
201	600011	华能国际	5,800	43,268.00	0.12
202	600157	永泰能源	27,500	43,175.00	0.12
203	002601	龙佰集团	2,200	43,076.00	0.12
204	688777	中控技术	868	42,827.12	0.12
205	000002	万科A	9,200	42,780.00	0.12
206	002273	水晶光电	1,700	42,704.00	0.12
207	002472	双环传动	900	42,669.00	0.12
208	300223	北京君正	400	42,416.00	0.12
209	002595	豪迈科技	500	42,255.00	0.12
210	600741	华域汽车	2,100	42,000.00	0.12
211	002281	光迅科技	600	41,970.00	0.12
212	002128	电投能源	1,500	41,865.00	0.12
213	000831	中国稀土	900	41,796.00	0.12
214	300418	昆仑万维	1,000	41,700.00	0.11
215	002456	欧菲光	3,900	41,418.00	0.11
216	601868	中国能建	17,600	41,360.00	0.11
217	601111	中国国航	4,400	41,228.00	0.11
218	300751	迈为股份	200	41,198.00	0.11
219	002008	大族激光	1,000	41,190.00	0.11
220	002422	科伦药业	1,400	41,090.00	0.11
221	600515	海南机场	7,700	41,041.00	0.11
222	002493	荣盛石化	3,500	40,985.00	0.11
223	002465	海格通信	2,600	40,950.00	0.11

224	600392	盛和资源	1,900	40,907.00	0.11
225	300782	卓胜微	500	40,740.00	0.11
226	000768	中航西飞	1,600	40,608.00	0.11
227	600673	东阳光	1,800	40,374.00	0.11
228	688002	睿创微纳	400	40,320.00	0.11
229	002001	新和成	1,600	40,304.00	0.11
230	003816	中国广核	10,700	40,232.00	0.11
231	002252	上海莱士	6,300	39,942.00	0.11
232	600460	士兰微	1,400	39,774.00	0.11
232	002236	大华股份	2,100	39,774.00	0.11
233	300347	泰格医药	700	39,690.00	0.11
234	002812	恩捷股份	700	39,648.00	0.11
235	601800	中国交建	4,800	39,552.00	0.11
236	601872	招商轮船	4,400	39,512.00	0.11
237	600895	张江高科	900	39,510.00	0.11
238	000963	华东医药	1,000	39,450.00	0.11
239	002138	顺络电子	1,100	39,083.00	0.11
240	000878	云南铜业	1,900	38,969.00	0.11
241	301358	湖南裕能	600	38,796.00	0.11
242	601319	中国人保	4,300	38,485.00	0.11
243	601633	长城汽车	1,700	38,471.00	0.11
244	688017	绿的谐波	200	38,420.00	0.11
245	002185	华天科技	3,500	38,395.00	0.11
246	603659	璞泰来	1,400	38,276.00	0.11
247	300390	天华新能	700	38,227.00	0.11
248	000301	东方盛虹	3,500	38,115.00	0.11
249	603979	金诚信	500	38,075.00	0.10
250	301236	软通动力	800	37,944.00	0.10
251	600233	圆通速递	2,300	37,766.00	0.10
252	002129	TCL中环	4,400	37,708.00	0.10
253	601117	中国化学	5,000	37,650.00	0.10

254	600699	均胜电子	1,200	37,632.00	0.10
255	300054	鼎龙股份	1,000	37,600.00	0.10
256	600372	中航机载	2,800	37,576.00	0.10
257	000066	中国长城	2,600	37,466.00	0.10
258	600352	浙江龙盛	3,500	37,310.00	0.10
259	600745	闻泰科技	1,000	37,280.00	0.10
260	688506	百利天恒	115	37,156.50	0.10
261	002497	雅化集团	1,500	37,125.00	0.10
262	000661	长春高新	400	37,020.00	0.10
263	300346	南大光电	860	36,894.00	0.10
264	002130	沃尔核材	1,400	36,848.00	0.10
265	600886	国投电力	2,800	36,736.00	0.10
266	300037	新宙邦	700	36,680.00	0.10
267	688169	石头科技	240	36,494.40	0.10
268	001979	招商蛇口	4,200	36,288.00	0.10
269	601877	正泰电器	1,300	36,257.00	0.10
270	000960	锡业股份	1,300	36,244.00	0.10
271	002078	太阳纸业	2,300	36,225.00	0.10
272	601615	明阳智能	2,500	36,200.00	0.10
273	600674	川投能源	2,600	36,140.00	0.10
274	002920	德赛西威	300	36,090.00	0.10
275	688396	华润微	672	35,521.92	0.10
276	002648	卫星化学	2,000	35,360.00	0.10
277	688099	晶晨股份	400	34,892.00	0.10
278	002294	信立泰	700	34,685.00	0.10
279	300073	当升科技	600	34,680.00	0.10
280	600141	兴发集团	1,000	34,580.00	0.10
281	300454	深信服	300	34,548.00	0.10
282	605117	德业股份	400	34,480.00	0.10
283	300866	安克创新	300	34,317.00	0.09
284	300759	康龙化成	1,200	34,116.00	0.09

285	603087	甘李药业	500	34,035.00	0.09
286	002271	东方雨虹	2,500	33,975.00	0.09
287	600039	四川路桥	3,400	33,830.00	0.09
288	300017	网宿科技	3,300	33,825.00	0.09
289	300496	中科创达	500	33,750.00	0.09
290	002414	高德红外	2,300	33,741.00	0.09
291	300661	圣邦股份	490	33,633.60	0.09
292	600588	用友网络	2,500	33,150.00	0.09
293	601233	桐昆股份	1,900	32,699.00	0.09
294	000617	中油资本	3,400	32,640.00	0.09
295	000786	北新建材	1,300	32,461.00	0.09
296	002085	万丰奥威	2,000	32,020.00	0.09
297	302132	中航成飞	400	31,600.00	0.09
298	002155	湖南黄金	1,490	31,424.10	0.09
299	300012	华测检测	2,300	31,165.00	0.09
300	000034	神州数码	800	31,128.00	0.09
301	300251	光线传媒	1,900	31,122.00	0.09
302	600482	中国动力	1,500	31,050.00	0.09
303	300024	机器人	1,700	30,923.00	0.09
304	002459	晶澳科技	2,700	30,915.00	0.09
305	603596	伯特利	600	30,762.00	0.08
306	300748	金力永磁	900	30,699.00	0.08
307	002444	巨星科技	900	30,618.00	0.08
308	002223	鱼跃医疗	800	30,568.00	0.08
309	688223	晶科能源	5,381	30,348.84	0.08
310	688266	泽璟制药	327	30,312.90	0.08
311	300122	智飞生物	1,600	30,192.00	0.08
312	300002	神州泰岳	2,600	29,952.00	0.08
313	601021	春秋航空	500	29,750.00	0.08
314	002409	雅克科技	400	29,640.00	0.08
315	600256	广汇能源	6,000	29,520.00	0.08

316	002624	完美世界	1,800	29,502.00	0.08
317	688578	艾力斯	283	29,474.45	0.08
318	000423	东阿阿胶	600	29,448.00	0.08
319	300316	晶盛机电	800	29,400.00	0.08
320	688599	天合光能	1,774	29,359.70	0.08
321	600085	同仁堂	900	29,034.00	0.08
322	300474	景嘉微	400	28,748.00	0.08
323	600765	中航重机	1,500	28,740.00	0.08
324	300724	捷佳伟创	300	28,680.00	0.08
325	300896	爱美客	200	28,344.00	0.08
326	688213	思特威	298	28,336.82	0.08
327	000683	博源化工	3,800	28,272.00	0.08
328	601618	中国中冶	9,500	28,215.00	0.08
329	300832	新产业	500	28,125.00	0.08
330	002405	四维图新	3,100	27,931.00	0.08
331	603129	春风动力	100	27,868.00	0.08
332	600497	驰宏锌锗	3,800	27,778.00	0.08
333	688472	阿特斯	1,861	27,747.51	0.08
334	300699	光威复材	700	27,622.00	0.08
335	002065	东华软件	3,000	27,450.00	0.08
336	300285	国瓷材料	1,000	27,410.00	0.08
337	688303	大全能源	1,021	27,383.22	0.08
338	002756	永兴材料	500	27,125.00	0.07
339	300003	乐普医疗	1,700	26,877.00	0.07
340	688047	龙芯中科	200	26,422.00	0.07
341	002410	广联达	2,100	26,418.00	0.07
342	601179	中国西电	2,900	26,390.00	0.07
343	603260	合盛硅业	500	26,350.00	0.07
344	002180	纳思达	1,300	26,286.00	0.07
345	000039	中集集团	2,600	26,234.00	0.07
346	001965	招商公路	2,600	26,208.00	0.07

347	000733	振华科技	500	26,205.00	0.07
348	688005	容百科技	739	26,160.60	0.07
349	002318	久立特材	900	26,055.00	0.07
350	300568	星源材质	1,700	25,925.00	0.07
351	000400	许继电气	1,000	25,710.00	0.07
352	600026	中远海能	2,200	25,696.00	0.07
353	300001	特锐德	1,000	25,680.00	0.07
354	600498	烽火通信	800	25,664.00	0.07
355	600637	东方明珠	2,600	25,610.00	0.07
356	605589	圣泉集团	900	25,470.00	0.07
357	002064	华峰化学	2,300	25,300.00	0.07
358	002245	蔚蓝锂芯	1,400	24,920.00	0.07
359	600803	新奥股份	1,200	24,912.00	0.07
360	000932	华菱钢铁	4,400	24,728.00	0.07
361	601799	星宇股份	200	24,674.00	0.07
362	000009	中国宝安	2,500	24,625.00	0.07
363	300627	华测导航	700	24,437.00	0.07
364	600177	雅戈尔	3,200	24,320.00	0.07
365	603486	科沃斯	300	24,204.00	0.07
366	300142	沃森生物	2,200	24,002.00	0.07
367	002389	航天彩虹	1,000	23,980.00	0.07
368	603606	东方电缆	400	23,900.00	0.07
369	688180	君实生物	698	23,843.68	0.07
370	600521	华海药业	1,400	23,758.00	0.07
371	601677	明泰铝业	1,600	23,664.00	0.07
372	600862	中航高科	1,000	23,630.00	0.07
373	000999	华润三九	830	23,621.80	0.07
374	002152	广电运通	1,700	23,477.00	0.06
375	000738	航发控制	1,100	23,441.00	0.06
376	000623	吉林敖东	1,200	23,436.00	0.06
377	002176	江特电机	2,400	23,376.00	0.06

378	300757	罗博特科	100	23,330.00	0.06
379	002044	美年健康	4,400	23,232.00	0.06
380	000887	中鼎股份	1,000	23,210.00	0.06
381	000830	鲁西化工	1,400	23,198.00	0.06
382	600332	白云山	900	23,166.00	0.06
383	300919	中伟新材	500	23,165.00	0.06
384	688065	凯赛生物	465	23,157.00	0.06
385	603568	伟明环保	900	22,842.00	0.06
386	600704	物产中大	4,100	22,837.00	0.06
387	600845	宝信软件	1,100	22,781.00	0.06
388	002007	华兰生物	1,500	22,695.00	0.06
389	601216	君正集团	4,700	22,654.00	0.06
390	300383	光环新网	1,800	22,518.00	0.06
391	300459	汤姆猫	4,900	22,491.00	0.06
392	603392	万泰生物	500	22,470.00	0.06
393	300088	长信科技	3,700	22,422.00	0.06
394	600516	方大炭素	3,900	22,191.00	0.06
395	601238	广汽集团	2,700	22,032.00	0.06
396	300413	芒果超媒	900	21,978.00	0.06
397	688617	惠泰医疗	90	21,894.30	0.06
398	688188	柏楚电子	160	21,742.40	0.06
399	603077	和邦生物	9,600	21,696.00	0.06
400	600038	中直股份	600	21,678.00	0.06
401	601607	上海医药	1,200	21,432.00	0.06
402	300763	锦浪科技	300	21,423.00	0.06
403	300628	亿联网络	600	21,390.00	0.06
404	002607	中公教育	7,800	21,372.00	0.06
405	300438	鹏辉能源	400	21,288.00	0.06
406	000708	中信特钢	1,300	21,281.00	0.06
407	600563	法拉电子	200	20,990.00	0.06
408	600316	洪都航空	600	20,946.00	0.06

409	600486	扬农化工	300	20,817.00	0.06
410	601567	三星医疗	900	20,718.00	0.06
411	603605	珀莱雅	300	20,544.00	0.06
412	002603	以岭药业	1,200	20,484.00	0.06
413	002739	万达电影	1,800	20,376.00	0.06
414	600153	建发股份	2,200	20,350.00	0.06
415	300068	南都电源	1,300	20,202.00	0.06
416	300972	万辰集团	100	20,107.00	0.06
417	002025	航天电器	400	20,052.00	0.06
418	000519	中兵红箭	1,100	20,031.00	0.06
419	600323	瀚蓝环境	700	20,020.00	0.06
419	002432	九安医疗	500	20,020.00	0.06
420	600170	上海建工	7,500	19,875.00	0.05
421	002841	视源股份	500	19,815.00	0.05
422	688009	中国通号	3,618	19,790.46	0.05
423	002312	川发龙蟒	1,800	19,674.00	0.05
424	600161	天坛生物	1,200	19,608.00	0.05
425	601018	宁波港	5,400	19,602.00	0.05
426	603939	益丰药房	900	19,548.00	0.05
427	603806	福斯特	1,400	19,544.00	0.05
428	600008	首创环保	6,500	19,500.00	0.05
429	000415	渤海租赁	4,800	19,440.00	0.05
430	600499	科达制造	1,400	19,418.00	0.05
431	000629	钒钛股份	6,200	19,220.00	0.05
432	600312	平高电气	1,100	19,085.00	0.05
433	600018	上港集团	3,500	18,970.00	0.05
434	688166	博瑞医药	382	18,740.92	0.05
435	600859	王府井	1,200	18,636.00	0.05
436	002821	凯莱英	200	18,586.00	0.05
437	601880	辽港股份	11,600	18,560.00	0.05
438	300253	卫宁健康	2,100	18,522.00	0.05

439	603816	顾家家居	600	18,444.00	0.05
440	600166	福田汽车	6,300	18,396.00	0.05
441	300567	精测电子	200	18,240.00	0.05
442	601155	新城控股	1,300	18,135.00	0.05
443	600998	九州通	3,500	17,920.00	0.05
444	688063	派能科技	312	17,727.84	0.05
445	603650	彤程新材	400	17,656.00	0.05
446	300118	东方日升	1,200	17,592.00	0.05
447	600820	隧道股份	2,700	17,523.00	0.05
448	002544	普天科技	500	17,245.00	0.05
449	002145	钛能化学	3,500	17,150.00	0.05
450	600398	海澜之家	2,800	16,940.00	0.05
451	300573	兴齐眼药	240	16,869.60	0.05
452	688608	恒玄科技	74	16,793.56	0.05
453	300457	赢合科技	600	16,710.00	0.05
454	603885	吉祥航空	1,100	16,368.00	0.05
455	603899	晨光股份	600	16,236.00	0.04
456	000967	盈峰环境	2,200	16,148.00	0.04
457	600763	通策医疗	400	16,084.00	0.04
458	002244	滨江集团	1,600	16,080.00	0.04
459	600529	山东药玻	800	15,944.00	0.04
460	601000	唐山港	4,100	15,744.00	0.04
461	603833	欧派家居	300	15,627.00	0.04
462	300144	宋城演艺	1,900	15,561.00	0.04
463	002120	韵达股份	2,300	15,502.00	0.04
464	000818	航锦科技	800	15,440.00	0.04
465	600754	锦江酒店	600	15,162.00	0.04
466	600004	白云机场	1,600	15,136.00	0.04
467	600655	豫园股份	2,900	14,877.00	0.04
468	600511	国药股份	500	14,375.00	0.04
469	600667	太极实业	1,800	14,346.00	0.04

470	600816	建元信托	5,000	14,150.00	0.04
471	000998	隆平高科	1,500	14,040.00	0.04
472	300558	贝达药业	300	14,007.00	0.04
473	300083	创世纪	1,500	13,815.00	0.04
474	300529	健帆生物	700	13,769.00	0.04
475	300676	华大基因	300	13,608.00	0.04
476	600535	天士力	900	13,563.00	0.04
477	600208	衢州发展	3,500	13,545.00	0.04
478	600325	华发股份	3,200	13,504.00	0.04
479	600258	首旅酒店	800	13,400.00	0.04
480	002266	浙富控股	3,200	13,312.00	0.04
481	300601	康泰生物	900	13,293.00	0.04
482	000035	中国天楹	2,400	13,248.00	0.04
483	601966	玲珑轮胎	900	13,077.00	0.04
484	600864	哈投股份	1,900	12,597.00	0.03
485	688390	固德威	200	12,426.00	0.03
486	601866	中远海发	4,900	12,348.00	0.03
487	002572	索菲亚	900	12,249.00	0.03
488	300070	碧水源	3,000	11,760.00	0.03
489	000069	华侨城A	4,700	11,656.00	0.03
490	000032	深桑达A	600	11,610.00	0.03
491	600867	通化东宝	1,400	11,438.00	0.03
492	002091	江苏国泰	1,200	10,836.00	0.03
493	002891	中宠股份	200	10,352.00	0.03
494	600007	中国国贸	500	9,910.00	0.03
495	002292	奥飞娱乐	1,100	9,735.00	0.03
496	001914	招商积余	900	9,612.00	0.03
497	002701	奥瑞金	1,500	8,925.00	0.02

8.3.2 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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	4,518,545.00	12.45
2	300750	宁德时代	3,326,182.00	9.17
3	601318	中国平安	2,603,698.00	7.18
4	600036	招商银行	2,445,845.00	6.74
5	000333	美的集团	1,655,389.00	4.56
6	601166	兴业银行	1,616,414.00	4.46
7	600900	长江电力	1,594,695.00	4.40
8	002594	比亚迪	1,526,292.00	4.21
9	300059	东方财富	1,378,101.00	3.80
10	601899	紫金矿业	1,366,717.00	3.77
11	600030	中信证券	1,249,019.00	3.44
12	000858	五粮液	1,198,414.00	3.30
13	601398	工商银行	1,136,517.00	3.13
14	600276	恒瑞医药	1,022,984.60	2.82
15	002475	立讯精密	998,418.00	2.75
16	688981	中芯国际	930,070.87	2.56
17	601328	交通银行	907,558.00	2.50
18	000651	格力电器	898,585.00	2.48
19	600887	伊利股份	827,555.00	2.28
20	688256	寒武纪	825,738.00	2.28
21	601288	农业银行	798,229.00	2.20
22	300308	中际旭创	790,329.00	2.18
23	603259	药明康德	784,348.00	2.16
24	601816	京沪高铁	765,987.00	2.11

25	000725	京东方A	735,363.00	2.03
26	300760	迈瑞医疗	725,646.00	2.00

注：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。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	3,320,689.00	9.15
2	300750	宁德时代	2,620,034.00	7.22
3	601318	中国平安	2,191,922.00	6.04
4	600036	招商银行	1,968,871.00	5.43
5	601166	兴业银行	1,327,969.00	3.66
6	600900	长江电力	1,266,955.00	3.49
7	000333	美的集团	1,263,743.00	3.48
8	601899	紫金矿业	1,217,848.00	3.36
9	002594	比亚迪	1,056,435.00	2.91
10	300059	东方财富	1,054,012.00	2.91
11	600030	中信证券	977,633.00	2.69
12	601398	工商银行	970,505.00	2.67
13	600276	恒瑞医药	901,553.00	2.48
14	000858	五粮液	840,884.00	2.32
15	600919	江苏银行	775,567.00	2.14
16	300308	中际旭创	764,580.00	2.11
17	601288	农业银行	743,208.00	2.05
18	601328	交通银行	719,632.00	1.98
19	000651	格力电器	718,431.00	1.98
20	603259	药明康德	714,143.00	1.97

注：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。

8.4.3 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	109,580,532.35
卖出股票收入（成交）总额	83,878,980.46

注：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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**8.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注**8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明**

本基金投资的前十名证券中，招商银行、兴业银行在报告编制日前一年内受过立案调查或公开处罚，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。

本基金投资的其余前十名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。

8.12.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 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	23,681.55
2	应收清算款	315,728.90
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	29,884.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	369,295.01

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
汇安中证A500指数A	153	35,980.45	3,158,281.85	57.37%	2,346,727.44	42.63%
汇安中证A500指数C	433	55,925.11	876,438.09	3.62%	23,339,133.08	96.38%
合计	570	52,141.37	4,034,719.94	13.58%	25,685,860.52	86.42%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	汇安中证A500指数A	21,707.37	0.3943%
	汇安中证A500指数C	0.00	0.0000%
	合计	21,707.37	0.0730%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	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	汇安中证A500指数	0

和研究部门负责人持有本开放式基金	A	
	汇安中证A500指数C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇安中证A500指数A	0~10
	汇安中证A500指数C	0
	合计	0~10

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

无

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	汇安中证A500指数A	汇安中证A500指数C
基金合同生效日(2025年01月24日)基金份额总额	12,048,516.92	210,904,373.13
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	9,162,821.92	18,003,718.75
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	15,706,329.55	204,692,520.71
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	5,505,009.29	24,215,571.17

注：1.申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 本基金自2024年12月24日至2025年1月21日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币222,905,833.65元，折合为222,905,833.65份基金份额(其中A类基金份额12,045,372.58份，C类基金份额210,860,461.07份)。根据《汇安中证A500指数证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币47,056.40元在本基金成立后，折合为47,056.40份基金份额(其中A类基金份额3,144.34份，C类基金份额43,912.06份)，划入基金份额持有人账户。

3. 根据《汇安中证A500指数证券投资基金基金合同》、《汇安中证A500指数证券投资基金招募说明书》及《汇安中证A500指数证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告》的相关规定，本基金于2025年1月24日(基金合同生效日)至2025年2月23日止期间暂不向投资人开放基金交易，申购业务、赎回业务、转换业务及定期定额投资业务自2025年2月24日起开始办理。

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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，基金管理人无重大人事变动。

2025年1月，中国光大银行股份有限公司聘任贾光华先生担任资产托管部总经理职务。

11.3 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事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金在报告期内基金投资策略没有改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自2025年1月24日至本告期末聘任容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本报告期内未发生变动。本基金本报告期应支付给容诚会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用42,000.00元，其中本基金支付的审计费为33,649.94元，剩余部分由本基金的管理人承担。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人未受到调查或处罚。

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员未受到调查或处罚。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人无受调查或处罚等情况。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
天风证券	2	193,236,442.17	100.00%	35,925.82	100.00%	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：

选择专用席位的标准和程序：

(1) 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，具备健全的内部控制制度；
- 4、研究实力较强，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；能够积极进行业务交流，定期进行观点交流和路演；能够提供实地调研等多种类型的研究服务；

5、具有佣金费率优势，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，能提供全面的交易信息服务；

6、从制度上和技术上保证管理人租用交易单元的交易信息严格保密。

(2) 选择程序

- 1、本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的券商。
- 2、本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议。

(3) 交易单元变更情况

本基金本报告期内新增交易单元:天风证券2个、中信证券2个。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
天风证券	-	-	818,767,000.00	100.00%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

11.8 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	汇安中证A500指数证券投资基金基金合同生效公告	规定报刊和/或公司网站	2025-01-25
2	汇安中证A500指数证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	规定报刊和/或公司网站	2025-02-21
3	汇安中证A500指数证券投资基金2025年第1季度报告	规定报刊和/或公司网站	2025-04-22
4	汇安基金管理有限责任公司关于网上直销平台系统维护的公告	规定报刊和/或公司网站	2025-05-23
5	汇安基金管理有限责任公司关于旗下部分基金在直销渠道开展费率优惠活动的公告	规定报刊和/或公司网站	2025-07-01
6	汇安中证A500指数证券投资基金2025年第2季度报告	规定报刊和/或公司网站	2025-07-21

7	汇安中证A500指数证券投资基金2025年中期报告	规定报刊和/或公司网站	2025-08-30
8	汇安基金管理有限责任公司关于旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	规定报刊和/或公司网站	2025-09-05
9	汇安中证A500指数证券投资基金2025年第3季度报告	规定报刊和/或公司网站	2025-10-28
10	汇安中证A500指数证券投资基金（2025年第1号）招募说明书（更新）	规定报刊和/或公司网站	2025-11-11
11	汇安中证A500指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）	规定报刊和/或公司网站	2025-11-11
12	汇安基金管理有限责任公司关于旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	规定报刊和/或公司网站	2025-12-26

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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

本基金本报告期内未存在单一基金份额持有人持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准汇安中证A500指数证券投资基金募集的文件
- (2) 《汇安中证A500指数证券投资基金基金合同》
- (3) 《汇安中证A500指数证券投资基金招募说明书》
- (4) 《汇安中证A500指数证券投资基金托管协议》
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (6) 在规定报刊及规定网站上披露的各项公告
- (7) 中国证监会规定的其他文件

13.2 存放地点

北京市东城区东直门南大街5号中青旅大厦13层
上海市虹口区东大名路501白玉兰大厦36层

13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所及网站免费查阅备查文件，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人汇安基金管理有限责任公司，客户服务中心电话010-56711690。

公司网站：<http://www.huianfund.cn>

汇安基金管理有限责任公司
二〇二六年三月三十一日