

# 嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资 基金 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2023 年 3 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。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 03 月 24 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 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
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 其他指标	8
3.4 过去三年基金的利润分配情况	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	13
4.10 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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
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	14
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>14</b>
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	14
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>16</b>
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	17
7.3 净资产（基金净值）变动表	18
7.4 报表附注	22

<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>80</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	80
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	80
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 .....	82
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	95
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	96
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 .....	96
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 .....	96
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 .....	96
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 .....	96
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	96
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	97
8.12 投资组合报告附注 .....	97
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>98</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	98
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	98
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	99
9.4 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 .....	99
9.5 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 .....	99
<b>§ 10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>99</b>
<b>§ 11 重大事件揭示</b> .....	<b>100</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	100
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 .....	100
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	100
11.4 基金投资策略的改变 .....	100
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	100
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	100
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	101
11.8 其他重大事件 .....	104
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>105</b>
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 .....	105
<b>§ 13 备查文件目录</b> .....	<b>106</b>
13.1 备查文件目录 .....	106
13.2 存放地点 .....	106
13.3 查阅方式 .....	106

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	嘉实中证 500ETF
场内简称	中证 500ETF
基金主代码	159922
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 2 月 6 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,378,269,931.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2013 年 3 月 15 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的最小化。
投资策略	<p>本基金采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组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。但因特殊情况（如流动性原因）导致无法获得足够数量的股票时，或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时，基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到跟踪标的指数的目的。</p> <p>本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，筛选具有比较优势的存托凭证作为投资标的。本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如期权、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。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，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。</p> <p>本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。</p>
业绩比较基准	中证 500 指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动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	嘉实基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司	
信息披露 负责人	姓名	胡勇钦	王小飞
	联系电话	(010)65215588	021-60637103
	电子邮箱	service@jsfund.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话	400-600-8800	021-60637228	
传真	(010)65215588	021-60635778	
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 1806A 单元	北京市西城区金融大街 25 号	
办公地址	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼	
邮政编码	100005	100033	
法定代表人	经雷	田国立	

## 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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金年度报告备置地点	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标、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	2022 年	2021 年	2020 年
本期已实现收益	-311,783,883.85	423,544,426.72	921,499,740.31
本期利润	-856,056,684.97	537,720,658.45	833,969,075.34
加权平均基金份额本期利润	-1.2220	1.3526	1.7109
本期加权平均净值利润率	-19.35%	17.92%	27.17%
本期基金份额净值	-18.56%	17.96%	25.02%

增长率			
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
期末可供分配利润	3,856,099,128.04	2,089,051,047.09	1,794,960,434.33
期末可供分配基金份额利润	2.7978	4.6513	3.4000
期末基金资产净值	8,255,443,230.29	3,690,907,858.29	3,677,862,359.06
期末基金份额净值	5.9897	8.2179	6.9665
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
基金份额累计净值增长率	87.66%	130.42%	95.33%

注：（1）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。

（2）上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。

（3）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。

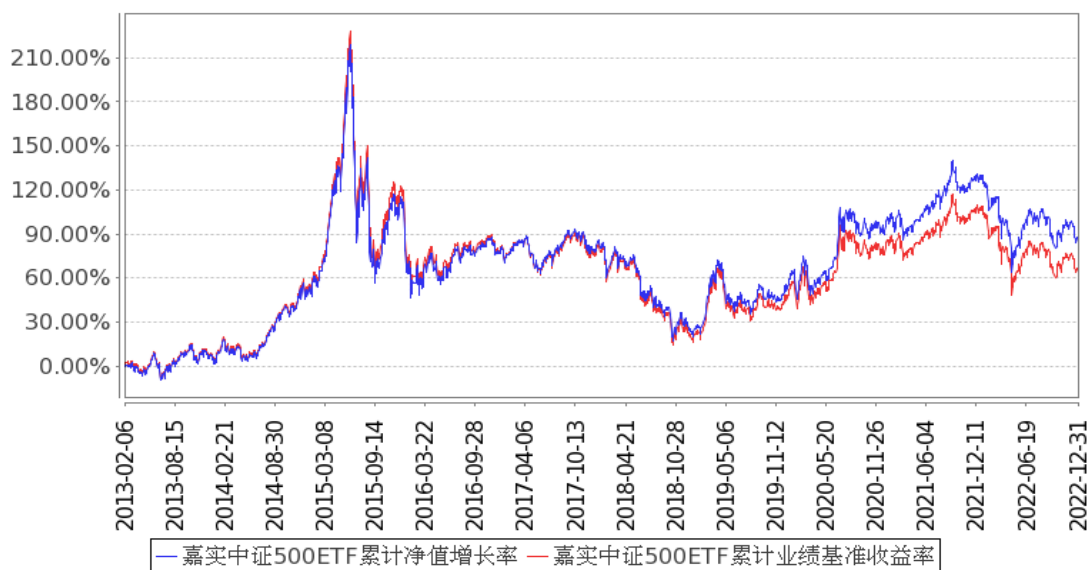
## 3.2 基金净值表现

### 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
过去三个月	2.79%	1.02%	2.63%	1.03%	0.16%	-0.01%
过去六个月	-8.40%	1.09%	-9.14%	1.10%	0.74%	-0.01%
过去一年	-18.56%	1.38%	-20.31%	1.38%	1.75%	0.00%
过去三年	20.11%	1.35%	11.33%	1.35%	8.78%	0.00%
过去五年	4.18%	1.41%	-6.18%	1.41%	10.36%	0.00%
自基金合同生效起至今	87.66%	1.60%	66.57%	1.61%	21.09%	-0.01%

### 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

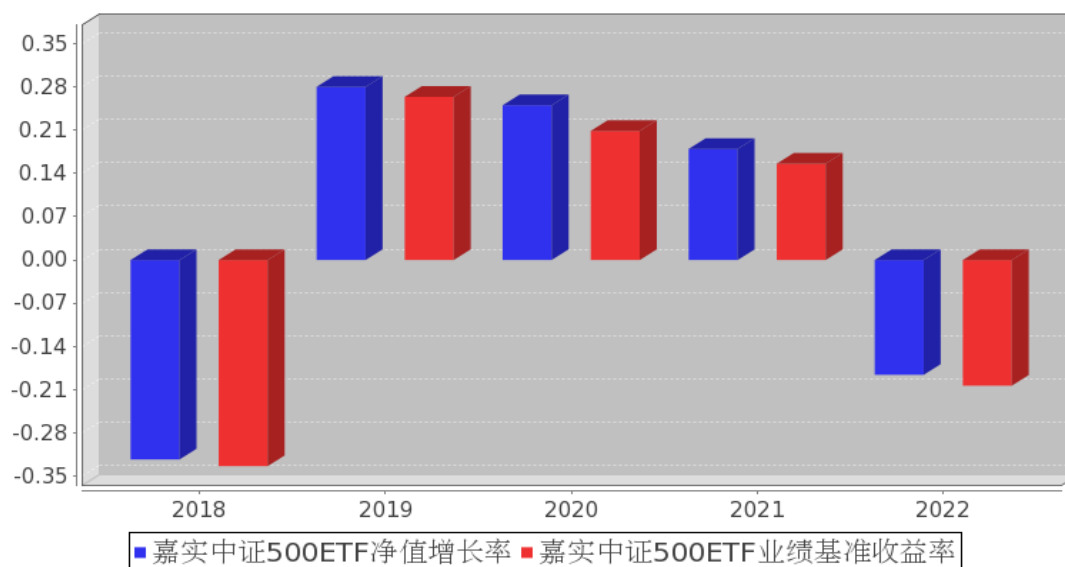
嘉实中证500ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2013年02月06日至2022年12月31日)



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3个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

### 3.2.3 过去五年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

嘉实中证500ETF基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：上述数据根据基金当年实际存续期计算。

### 3.3 其他指标

无。



### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5号文批准，于1999年3月25日成立，是中国第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，总部设在北京并设北京、深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII和特定资产管理业务等资格。

截止2022年12月31日，基金管理人共管理298只开放式证券投资基金，覆盖主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、资产配置、海外投资、FOF等不同类别。同时，还管理多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和单一/集合资产管理计划。

#### 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		
何如	本基金、嘉实沪深300ETF联接(LOF)、嘉实沪深300ETF、嘉实中证500ETF联接基金经理	2016年1月5日	-	16年	曾任职于IA 克莱灵顿投资管理公司(IA-Clarington Investments Inc)、富兰克林坦普顿投资管理公司(Franklin Templeton Investments Corp.)。2007年6月加入嘉实基金管理有限公司，先后任职于产品管理部、指数投资部，现任指数投资部执行总监、基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格。加拿大国籍。
李直	本基金、嘉实基本面50指数(LOF)、嘉实深证基本面120ETF、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实黄金	2021年9月24日	-	8年	2014年7月加入嘉实基金管理有限公司，从事指数基金投资研究工作，现任基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

(QDII-FOF-LOF)、嘉实中证500ETF联接、嘉实基本面50ETF、嘉实中证大农业ETF、嘉实恒生科技ETF(QDII)、嘉实中证科创创业50ETF、嘉实中证新能源汽车指数、嘉实中证科创创业50ETF发起联接、嘉实中证信息安全主题ETF、嘉实中证医疗指数发起式、嘉实中证光伏产业指数发起式、嘉实上海金ETF基金经理				
--	--	--	--	--

注：(1) 首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，此后的非首任基金经理的“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期。

(2) 证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

#### 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《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》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 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易管理制度》，按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司公平交易管理制度要求境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，并在投资决策委员会的制度规范下独立决策，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则，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、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素，交易后按照价格优先、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，公司严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；对投资交易行为进行监察稽核，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控和定期分析评估并完整详实记录相关信息，及时完成每季度和年度公平交易专项稽核。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的，合计 17 次，其中 1 次为旗下组合被动跟踪模拟组合权重配置需要与其他组合发生反向交易，另 16 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内，本基金日均跟踪误差为 0.02%，年度化拟合偏离度为 0.36%。

本基金的跟踪误差主要来源于基金的申购赎回、样本股停牌、样本股分红以及样本股调整的冲击。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 5.9897 元；本报告期基金份额净值增长率为-18.56%，业绩比较基准收益率为-20.31%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2023 年，中证 500 指数在众多指数中，属于高波动、高收益指数，其中长期收益相对大部分指数而言，存在明显优势。随着未来中国经济发展更加倚重机制创新、技术创新，政府资源、市场资源也将较多地偏向新兴产业和机制灵活市场化程度高的中小型企业。中证 500 指数相对其他主流指数，其中小市值个股占比较大，因此对转型经济中的新兴产业代表性更强。

本基金作为一只投资于中证 500 指数的被动投资管理产品，我们继续秉承指数化被动投资策略，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，降低本基金的跟踪误差，给投资者提供一个标准化的中证 500 指数的投资工具。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，基金管理人有关监察稽核工作情况如下：

(1) 继续内控前置。在基金营销、投资管理、信息披露以及新产品设计开发、海外业务、另类业务、制度建设、合同管理、法律咨询等方面，事前进行合规性审核、监控。全力支持创新业务，包括新产品新业务，产品生命周期支持也包括从战略规划到具体产品方案、业务模式、制度流程。在制度流程、投资范围、投资工具、运作规则等方面，防控重大风险。

(2) 全流程动态开展投资交易监督。一是事前防范，主要从事前研讨，合规风险识别、评估和分析，IT 事前设置，建立禁限库，合规培训、承诺书等方面开展；二是事中实时监控，如实时回答组合经理、交易员投资交易事项，盘中交易审批，盘中实时监控等；三是事后检查及改进，如检查投资交易合规情况，对异常行为进行提示、处理建议并督促改正。

(3) 按计划对销售、投资、后台和其它业务开展内部稽核，完成相应内审报告及其后续改进跟踪。完成公司及基金的外审、公司 GIPS 第三方验证、ISAE3402 国际鉴证等。

(4) 基金法务工作。包括合同、协议审查，主动解决各项法律文件以及实务运作中存在的差错和风险隐患，重点防控新增产品、新增业务以及日常业务的法律风险问题。

(5) 加强差错管理。继续推动各业务单元梳理流程、制度，落实风险责任授权体系，确保所有识别的关键风险点均有相应措施控制。

此外，我们还积极配合监管，按时完成合规报告和各项统计报表以及专题报告。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括基金投资市场的各证券交易所以及境内相关机构等。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期，本基金未实施利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。具体参见本报告“7.4.11 利润分配情况”。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

#### 4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 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

本托管人复核审查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。

## § 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	普华永道中天审字(2023)第 25269 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	嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“嘉实中证 500ETF 基金”)的财务报表,包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表,2022 年度的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</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,公允反映了嘉实中证 500ETF 基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<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。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>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于嘉实中证 500ETF 基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>嘉实中证 500ETF 基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司(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</p>

	<p>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嘉实中证 500ETF 基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算嘉实中证 500ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督嘉实中证 500ETF 基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<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>(一) 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>(二) 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>(三) 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>(四) 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，就可能对嘉实中证 500ETF 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嘉实中证 500ETF 基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、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。</p> <p>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	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	张勇   周祎
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2023 年 03 月 27 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	89,776,778.49	16,855,551.78
结算备付金		20,358,179.62	32,975,602.17
存出保证金		10,487,737.62	12,528,623.06
交易性金融资产	7.4.7.2	8,174,750,196.18	3,600,899,564.62
其中：股票投资		8,174,750,196.18	3,600,651,564.62
基金投资		-	-
债券投资		-	248,000.00
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	-	31,000,000.00
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	4,722,652.91
应收股利		154,000.00	1,680.00
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	237,412.12	167,434.88
资产总计		8,295,764,304.03	3,699,151,109.42
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		36,152,652.95	6,316,479.15
应付赎回款		-	-



应付管理人报酬		989,578.38	421,187.25
应付托管费		329,859.47	140,395.77
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		23,793.66	12,728.57
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	2,825,189.28	1,352,460.39
负债合计		40,321,073.74	8,243,251.13
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	4,399,344,102.25	1,601,856,811.20
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	3,856,099,128.04	2,089,051,047.09
净资产合计		8,255,443,230.29	3,690,907,858.29
负债和净资产总计		8,295,764,304.03	3,699,151,109.42

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 5.9897 元，基金份额总额 1,378,269,931.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-845,671,248.81	552,835,805.51
1. 利息收入		14,246,412.51	11,620,367.50
其中：存款利息收入	7.4.7.13	546,069.64	545,351.96
债券利息收入		-	807.93
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		454,970.50	764,765.15
证券出借利息收入		13,245,372.37	10,309,442.46
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-326,629,788.85	417,927,925.52
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-375,707,140.80	364,272,427.91
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	2,738,188.52	782,663.43
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-	-

贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-5,416,613.92	16,693,760.78
股利收益	7.4.7.19	51,755,777.35	36,179,073.40
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	-544,272,801.12	114,176,231.73
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	10,984,928.65	9,111,280.76
<b>减：二、营业总支出</b>		10,385,436.16	15,115,147.06
1. 管理人报酬		6,598,355.26	4,499,526.31
2. 托管费		2,199,451.73	1,499,842.00
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		47,697.68	111,596.53
8. 其他费用	7.4.7.23	1,539,931.49	9,004,182.22
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-856,056,684.97	537,720,658.45
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-856,056,684.97	537,720,658.45
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-856,056,684.97	537,720,658.45

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	1,601,856,811.20	-	2,089,051,047.09	3,690,907,858.29

加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产(基金净值)	1,601,856,811.20	-	2,089,051,047.09	3,690,907,858.29
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	2,797,487,291.05	-	1,767,048,080.95	4,564,535,372.00
(一)、综合收益总额	-	-	-856,056,684.97	-856,056,684.97
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	2,797,487,291.05	-	2,623,104,765.92	5,420,592,056.97
其中:1.基金申购款	5,622,115,990.01	-	5,308,397,236.12	10,930,513,226.13
2.基金赎回款	-2,824,628,698.96	-	-2,685,292,470.20	-5,509,921,169.16
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值	-	-	-	-

变动(净值减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	4,399,344,102.25	-	3,856,099,128.04	8,255,443,230.29
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	1,882,901,924.73	-	1,794,960,434.33	3,677,862,359.06
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	1,882,901,924.73	-	1,794,960,434.33	3,677,862,359.06
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-281,045,113.53	-	294,090,612.76	13,045,499.23
(一)、综合收益总额	-	-	537,720,658.45	537,720,658.45
(二)、本期基金份额交易产	-281,045,113.53	-	-243,630,045.69	-524,675,159.22

生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)				
其中:1. 基金申购款	2,937,420,752.84	-	3,175,631,854.99	6,113,052,607.83
2. 基金赎回款	-3,218,465,866.37	-	-3,419,261,900.68	-6,637,727,767.05
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	1,601,856,811.20	-	2,089,051,047.09	3,690,907,858.29

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：

经雷

基金管理人负责人

梁凯

主管会计工作负责人

李袁

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

嘉实中证 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[2012]1588 号《关于核准嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》核准,由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定。经向中国证监会备案,《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2013 年 2 月 6 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 3,108,729,402.00 份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

### 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》、《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 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。

本财务报表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

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期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。

#### 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

新金融工具准则

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或金融负债。

### (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。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。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、资产支持证券投资 and 基金投资，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) 金融负债的分类

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。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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息

继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

基金目前以交易目的持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在资产负债表中以交易性金融资产列示。基金目前以交易目的持有的衍生工具所产生的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在资产负债表中以衍生金融资产列示。

基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。基金目前以交易目的持有的衍生工具所产生的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，在资产负债表中以衍生金融负债列示。基金持有的其他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。

### 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

#### 新金融工具准则

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和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。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，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的已宣告但尚未发放的现金股利、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，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的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和金融负债，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。

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

基金持有的股票投资、基金投资、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。对于曾经实施份额拆分或折算的基金, 由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。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认列。对于已开放转换业务的基金, 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。

#### 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分配的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

##### 新金融工具准则

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。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

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相关交易费用及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。

基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

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。

##### 原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债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利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分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利息收入。

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。

转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

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

基金的管理人报酬、托管费等费用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

本基金的每份基金份额享有同等分配权。基金收益评价日核定的基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，基金管理人可以进行收益分配。在符合上述基金分红条件的前提下，本基金收益每年至多分配 12 次，每次基金收益分配数额的确定原则为使收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日(即收益评价日)的

基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值。基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日。本基金收益分配采取现金分红。

经宣告的拟分配基金收益于分红除息日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

无。

#### 7.4.4.13 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。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据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，基金确定以下类别股票投资和债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。

(2) 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《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度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。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。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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，财政部于 2022 年颁布了《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》（财会[2022]14 号），中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

#### (a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收利息、应收证券清算款和应收股利，金额分别为 16,855,551.78 元、32,975,602.17 元、12,528,623.06 元、31,000,000.00 元、167,434.88 元、4,722,652.91 元和 1,680.00 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、其他资产-应收利息、应收清算款和应收股利，金额分别为 16,857,887.01 元、32,994,084.41 元、12,528,749.12 元、30,989,714.57 元、156,747.01 元、4,722,652.91 元和 1,680.00 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 3,600,899,564.62 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 3,600,899,594.39 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 6,316,479.15 元、421,187.25 元、140,395.77 元、897,188.81 元和 455,271.58 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，

金额分别为 6,316,479.15 元、421,187.25 元、140,395.77 元、897,188.81 元和 455,271.58 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日, 本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日, 本基金根据新金融工具准则下的计量类别, 将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示, 无期初留存收益影响。

(b) 《资产管理产品相关会计处理规定》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》, 本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露, 这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 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

本基金本报告期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》及其他相关财税法规和实务操作, 主要税项列示如下:

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

(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 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	89,776,778.49	16,855,551.78
等于: 本金	89,770,263.73	16,855,551.78
加: 应计利息	6,514.76	-
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	89,776,778.49	16,855,551.78



## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		8,545,707,319.46	-	8,174,750,196.18	-370,957,123.28
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		8,545,707,319.46	-	8,174,750,196.18	-370,957,123.28
项目		上年度末 2021 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		3,435,494,686.78	-	3,600,651,564.62	165,156,877.84
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	248,000.00	-	248,000.00	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	248,000.00	-	248,000.00	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		3,435,742,686.78	-	3,600,899,564.62	165,156,877.84

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

## 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 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	74,224,000.00			
其中：股指期货投资	74,224,000.00			
其他衍生工具	-			
合计	74,224,000.00			
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 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	83,242,000.00			
其中：股指期货投资	83,242,000.00			
其他衍生工具	-			
合计	83,242,000.00			

#### 7.4.7.3.2 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
IC2303	IC2303	60.00	70,492,800.00	-3,731,200.00
合计				-3,731,200.00
减：可抵销期货暂收款				-3,731,200.00
净额				0.00

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 0。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，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

#### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

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

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	31,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	31,000,000.00	-

## 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

## 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

## 7.4.7.5 债权投资

## 7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

## 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

## 7.4.7.6 其他债权投资

## 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

## 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

## 7.4.7.7 其他权益工具投资

## 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

## 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应收利息	-	167,434.88
其他应收款	237,412.12	-
待摊费用	-	-
合计	237,412.12	167,434.88

## 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021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	2,054,556.59	897,188.81
其中：交易所市场	2,054,556.59	897,188.81
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	218,000.00	212,000.00
应付指数使用费	552,632.69	243,271.58
合计	2,825,189.28	1,352,460.39

## 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	449,131,868.00	1,601,856,811.20
本期申购	45,600,000.00	162,635,243.19
本期赎回（以“-”号填列）	-48,800,000.00	-174,048,242.75
2022年02月17日 基金拆分/ 份额折算前	445,931,868.00	1,590,443,811.64
基金拆分/份额折算调整	52,338,063.00	-
本期申购	1,710,400,000.00	5,459,480,746.82
本期赎回（以“-”号填列）	-830,400,000.00	-2,650,580,456.21
本期末	1,378,269,931.00	4,399,344,102.25

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

## 7.4.7.11 其他综合收益

无。

## 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	2,455,894,890.57	-366,843,843.48	2,089,051,047.09
本期利润	-311,783,883.85	-544,272,801.12	-856,056,684.97
本期基金份额交易产生的变动数	3,857,247,730.82	-1,234,142,964.90	2,623,104,765.92
其中：基金申购款	7,868,727,245.01	-2,560,330,008.89	5,308,397,236.12
基金赎回款	-4,011,479,514.19	1,326,187,043.99	-2,685,292,470.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,001,358,737.54	-2,145,259,609.50	3,856,099,128.04

#### 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
活期存款利息收入	119,400.83	81,278.09
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	420,582.98	455,452.94
其他	6,085.83	8,620.93
合计	546,069.64	545,351.96

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-181,244,434.48	277,445,886.55
股票投资收益——赎回差价收入	-194,462,706.32	86,826,541.36
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	-375,707,140.80	364,272,427.91

##### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
----	-----------------------------	----------------------------------

卖出股票成交总额	5,266,971,960.10	4,548,940,679.75
减：卖出股票成本总额	5,437,904,156.73	4,271,494,793.20
减：交易费用	10,312,237.85	-
买卖股票差价收入	-181,244,434.48	277,445,886.55

#### 7.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
赎回基金份额对价总额	5,509,921,169.16	6,637,727,767.05
减：现金支付赎回款总额	2,882,151,804.16	3,123,086,948.05
减：赎回股票成本总额	2,822,232,071.32	3,427,814,277.64
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-194,462,706.32	86,826,541.36

#### 7.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

#### 7.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
债券投资收益——利息收入	2,282.77	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,735,905.75	782,663.43
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-

合计	2,738,188.52	782,663.43
----	--------------	------------

#### 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31 日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	17,295,117.72	5,429,565.67
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	14,556,200.00	4,646,100.00
减：应计利息总额	2,354.86	802.24
减：交易费用	657.11	-
买卖债券差价收入	2,735,905.75	782,663.43

#### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

#### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

##### 7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

##### 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

#### 7.4.7.17 贵金属投资收益

##### 7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

##### 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

##### 7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 7.4.7.18 衍生工具收益

## 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 收益金额 2021年1月1日至2021年12月31日
股指期货投资收益	-5,416,613.92	16,693,760.78

## 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	51,755,777.35	36,179,073.40
其中：证券出借权益补偿收入	8,666,612.44	5,986,576.45
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	51,755,777.35	36,179,073.40

## 7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
1. 交易性金融资产	-536,114,001.12	111,647,231.73
股票投资	-536,114,001.12	111,647,231.73
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	-8,158,800.00	2,529,000.00
权证投资	-	-
期货投资	-8,158,800.00	2,529,000.00
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	-544,272,801.12	114,176,231.73

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	10,984,928.65	9,111,280.76
合计	10,984,928.65	9,111,280.76

#### 7.4.7.22 信用减值损失

无。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
审计费用	98,000.00	92,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	740.00	16,407.18
指数使用费	1,319,671.08	899,905.37
其他	68.00	541.00
存托服务费	1,452.41	-
交易费用	-	7,875,328.67
合计	1,539,931.49	9,004,182.22

#### 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
嘉实基金管理有限公司(“嘉实基金”)	基金管理人
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人
DWS Investments Singapore Limited	基金管理人的股东
立信投资有限责任公司	基金管理人的股东
中诚信托有限责任公司	基金管理人的股东

嘉实资本管理有限公司(“嘉实资本”)	基金管理人的控股子公司
嘉实财富管理有限公司(“嘉实财富”)	基金管理人的控股子公司
嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资 基金联接基金(“嘉实中证 500ETF 联接”)	本基金的联接基金

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 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 债券交易

无。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

###### 7.4.10.1.4 权证交易

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	6,598,355.26	4,499,526.31
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：1. 支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15%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×0.15%/当年天数。2. 根据本基金的基金管理人与各代销机构签订的基金代销协议，客户维护费按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算。

###### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,199,451.73	1,499,842.00

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 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：日托管费=前一日基金资产净值×0.05%/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自有资金投资本基金的情况

无。

##### 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2022年12月31日		上年度末 2021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（%）
嘉实中证 500ETF联接	355,502,628.00	25.79	265,970,831.00	59.22

#### 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 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司_活期	89,776,778.49	119,400.83	16,855,551.78	81,278.09

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 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

无。

## 7.4.11 利润分配情况

本期(2022年1月1日至2022年12月31日),本基金未实施利润分配。

## 7.4.12 期末(2022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

金额单位:人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别: 股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301095	广立微	2022年7月28日	6个月	新股锁定	58.00	86.49	740	42,920.00	64,002.60	-
301115	建科股份	2022年8月23日	6个月	新股锁定	42.05	24.04	685	28,804.25	16,467.40	-
301121	紫建电子	2022年8月1日	6个月	新股锁定	61.07	49.77	290	17,710.30	14,433.30	-
301132	满坤科技	2022年8月3日	6个月	新股锁定	26.80	24.48	468	12,542.40	11,456.64	-
301139	元道通信	2022年6月30日	6个月	新股锁定	38.46	25.31	566	21,768.36	14,325.46	-
301152	天力锂能	2022年8月19日	6个月	新股锁定	57.00	46.64	433	24,681.00	20,195.12	-
301161	唯万密封	2022年9月6日	6个月	新股锁定	18.66	21.73	346	6,456.36	7,518.58	-
301165	锐捷网络	2022年11月14日	6个月	新股锁定	32.38	31.61	1,077	34,873.26	34,043.97	-
301171	易点天下	2022年8月10日	6个月	新股锁定	18.18	17.72	985	17,907.30	17,454.20	-
301175	中科环保	2022年6月30日	6个月	新股锁定	3.82	6.01	6,370	24,333.40	38,283.70	-
301176	逸豪新材	2022年9月21日	6个月	新股锁定	23.88	16.89	544	12,990.72	9,188.16	-

301195	北路智控	2022年7月25日	6个月	新股锁定	71.17	73.04	330	23,486.10	24,103.20	-
301223	中荣股份	2022年10月13日	6个月	新股锁定	26.28	18.13	815	21,418.20	14,775.95	-
301227	森鹰窗业	2022年9月16日	6个月	新股锁定	38.25	29.49	284	10,863.00	8,375.16	-
301230	泓博医药	2022年10月21日	6个月	新股锁定	40.00	48.32	269	10,760.00	12,998.08	-
301231	荣信文化	2022年8月31日	6个月	新股锁定	25.49	20.38	275	7,009.75	5,604.50	-
301233	盛帮股份	2022年6月24日	6个月	新股锁定	41.52	34.30	158	6,560.16	5,419.40	-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	6个月	新股锁定	33.65	69.68	575	19,348.75	40,066.00	-
301265	华新环保	2022年12月8日	6个月	新股锁定	13.28	11.40	819	10,876.32	9,336.60	-
301267	华夏眼科	2022年10月26日	6个月	新股锁定	50.88	66.20	1,006	51,185.28	66,597.20	-
301269	华大九天	2022年7月21日	6个月	新股锁定	32.69	87.94	1,168	38,181.92	102,713.92	-
301273	瑞晨环保	2022年10月11日	6个月	新股锁定	37.89	37.79	277	10,495.53	10,467.83	-
301276	嘉曼服饰	2022年9月1日	6个月	新股锁定	40.66	22.61	303	12,319.98	6,850.83	-
301282	金禄电子	2022年8月18日	6个月	新股锁定	30.38	25.25	434	13,184.92	10,958.50	-
301285	鸿日达	2022年9月21日	6个月	新股锁定	14.60	12.60	565	8,249.00	7,119.00	-
301290	东星医疗	2022年11月23日	6个月	新股锁定	44.09	35.13	330	14,549.70	11,592.90	-

301296	新巨丰	2022年8月26日	6个月	新股锁定	18.19	14.90	1,042	18,953.98	15,525.80	-
301300	远翔新材	2022年8月9日	6个月	新股锁定	36.15	29.37	211	7,627.65	6,197.07	-
301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月	新股锁定	5.00	7.53	3,574	17,870.00	26,912.22	-
301306	西测测试	2022年7月19日	6个月	新股锁定	43.23	42.29	255	11,023.65	10,783.95	-
301308	江波龙	2022年7月27日	6个月	新股锁定	55.67	56.72	819	45,593.73	46,453.68	-
301309	万得凯	2022年9月8日	6个月	新股锁定	39.00	24.46	228	8,892.00	5,576.88	-
301311	昆船智能	2022年11月23日	6个月	新股锁定	13.88	15.86	832	11,548.16	13,195.52	-
301313	凡拓数创	2022年9月22日	6个月	新股锁定	25.25	29.14	247	6,236.75	7,197.58	-
301316	慧博云通	2022年9月29日	6个月	新股锁定	7.60	14.32	359	2,728.40	5,140.88	-
301318	维海德	2022年8月3日	6个月	新股锁定	64.68	41.74	206	13,324.08	8,598.44	-
301319	唯特偶	2022年9月22日	6个月	新股锁定	47.75	53.27	115	5,491.25	6,126.05	-
301326	捷邦科技	2022年9月9日	6个月	新股锁定	51.72	36.62	227	11,740.44	8,312.74	-
301327	华宝新能	2022年9月8日	6个月	新股锁定	237.50	176.97	242	57,475.00	42,826.74	-
301328	维峰电子	2022年8月30日	6个月	新股锁定	78.80	76.96	191	15,050.80	14,699.36	-
301330	熵基科技	2022年8月10日	6个月	新股锁定	43.32	31.31	694	30,064.08	21,729.14	-
301335	天元宠物	2022年11月11日	6个月	新股锁定	49.98	33.82	420	20,991.60	14,204.40	-
301338	凯格	2022年	6个月	新股锁	46.33	48.99	257	11,906.81	12,590.43	-

	精机	8月8日		定							
301339	通行宝	2022年9月2日	6个月	新股锁定	18.78	15.59	913	17,146.14	14,233.67		-
301349	信德新材	2022年8月30日	6个月	新股锁定	138.88	103.52	180	24,998.40	18,633.60		-
301356	天振股份	2022年11月3日	6个月	新股锁定	63.00	43.33	614	38,682.00	26,604.62		-
301361	众智科技	2022年11月8日	6个月	新股锁定	26.44	20.96	517	13,669.48	10,836.32		-
301363	美好医疗	2022年9月28日	6个月	新股锁定	30.66	37.85	445	13,643.70	16,843.25		-
301365	矩阵股份	2022年11月14日	6个月	新股锁定	34.72	23.87	516	17,915.52	12,316.92		-
301366	一博科技	2022年9月19日	6个月	新股锁定	65.35	45.09	268	17,513.80	12,084.12		-
301367	怡和嘉业	2022年10月21日	6个月	新股锁定	119.88	175.78	223	26,733.24	39,198.94		-
301368	丰立智能	2022年12月7日	6个月	新股锁定	22.33	18.52	337	7,525.21	6,241.24		-
301377	鼎泰高科	2022年11月11日	6个月	新股锁定	22.88	17.63	770	17,617.60	13,575.10		-
301379	天山电子	2022年10月19日	6个月	新股锁定	31.51	24.63	449	14,147.99	11,058.87		-
301388	欣灵电气	2022年10月26日	6个月	新股锁定	25.88	21.60	292	7,556.96	6,307.20		-
301389	隆扬电子	2022年10月18日	6个月	新股锁定	22.50	17.16	1,269	28,552.50	21,776.04		-
301391	卡莱特	2022年11月24日	6个月	新股锁定	96.00	80.97	247	23,712.00	19,999.59		-
301398	星源卓镁	2022年12月8日	6个月	新股锁定	34.40	28.94	255	8,772.00	7,379.70		-

		日							
--	--	---	--	--	--	--	--	--	--

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，新增股票的受限期、流通受限类型和期末估值价格与原股票一致。

#### 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
600038	中直股份	2022年12月26日	重大事项停牌	46.41	2023年01月10日	51.05	355,161	16,272,323.14	16,483,022.01	-
300850	新强联	2022年12月30日	重大事项停牌	53.28	2023年01月10日	56.88	255,280	15,061,020.28	13,601,318.40	-

#### 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：股）	期末估值总额
1	002340	格林美	2023年1月6日-2023年1月13日	7.43	748,000	5,557,640.00
2	300012	华测检测	2023年1月6日-2023年1月13日	22.30	244,900	5,461,270.00
3	600157	永泰能源	2023年1月6日-2023年1月13日	1.53	3,240,400	4,957,812.00
4	002384	东山精密	2023年1月6日-2023年1月13日	24.73	199,300	4,928,689.00
5	300724	捷佳伟创	2023年1月6日-2023年1月13日	114.02	40,700	4,640,614.00
6	688777	中控技术	2023年1月6日-2023年1月13日	90.83	50,700	4,605,081.00



7	603613	国联股份	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	88.44	50,900	4,501,596.00
8	688122	西部超导	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	94.69	47,300	4,478,837.00
9	300003	乐普医疗	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	22.97	192,000	4,410,240.00
10	002422	科伦药业	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	26.61	165,200	4,395,972.00
11	600487	亨通光电	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	15.06	287,500	4,329,750.00
12	002385	大北农	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	8.90	482,600	4,295,140.00
13	688063	派能科技	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	315.65	13,500	4,261,275.00
14	603345	安井食品	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	161.88	25,700	4,160,316.00
15	002966	苏州银行	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	7.78	534,600	4,159,188.00
16	603606	东方电缆	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	67.83	60,100	4,076,583.00
17	600885	宏发股份	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	33.41	121,500	4,059,315.00
18	600765	中航重机	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	31.09	128,700	4,001,283.00
19	600079	人福医药	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	23.89	166,600	3,980,074.00
20	600096	云天化	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	21.04	187,300	3,940,792.00
21	002497	雅化集团	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	23.25	168,000	3,906,000.00
22	601555	东吴证券	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	6.53	584,300	3,815,479.00
23	600352	浙江龙盛	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	9.90	379,100	3,753,090.00
24	002625	光启技术	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	17.02	219,600	3,737,592.00
25	002407	多氟多	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	33.32	111,700	3,721,844.00
26	002603	以岭药业	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	29.96	121,900	3,652,124.00
27	000009	中国宝安	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	12.09	300,800	3,636,672.00
28	601058	赛轮轮胎	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	10.02	357,000	3,577,140.00

29	002738	中矿资源	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	66.66	53,500	3,566,310.00
30	601233	桐昆股份	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	14.45	245,900	3,553,255.00
31	603605	珀莱雅	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	167.48	21,200	3,550,576.00
32	600988	赤峰黄金	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	18.05	193,900	3,499,895.00
33	600489	中金黄金	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	8.19	423,500	3,468,465.00
34	688390	固德威	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	323.09	10,700	3,457,063.00
35	603688	石英股份	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	131.32	26,300	3,453,716.00
36	603444	吉比特	2023 年 1 月 6 日	312.84	11,000	3,441,240.00
37	600298	安琪酵母	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	45.22	76,000	3,436,720.00
38	002028	思源电气	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	38.22	89,300	3,413,046.00
39	300146	汤臣倍健	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	22.82	148,600	3,391,052.00
40	601108	财通证券	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	7.12	473,700	3,372,744.00
41	000807	云铝股份	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	11.12	303,000	3,369,360.00
42	600536	中国软件	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	58.33	57,700	3,365,641.00
43	300390	天华超净	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	55.88	60,100	3,358,388.00
44	603939	益丰药房	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	63.84	52,500	3,351,600.00
45	600418	江淮汽车	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	13.13	254,600	3,342,898.00
46	300144	宋城演艺	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	14.60	228,700	3,339,020.00
47	300073	当升科技	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	56.40	59,000	3,327,600.00
48	300037	新宙邦	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	43.47	75,800	3,295,026.00
49	600563	法拉电子	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	159.88	20,600	3,293,528.00
50	600141	兴发集团	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	29.00	113,500	3,291,500.00

51	600399	抚顺特钢	2023年1月6日-2023年1月13日	14.31	229,900	3,289,869.00
52	300699	光威复材	2023年1月6日-2023年1月13日	72.25	45,300	3,272,925.00
53	600859	王府井	2023年1月6日-2023年1月13日	28.14	115,700	3,255,798.00
54	603517	绝味食品	2023年1月6日-2023年1月13日	61.09	53,200	3,249,988.00
55	300285	国瓷材料	2023年1月6日-2023年1月13日	27.57	117,100	3,228,447.00
56	601077	渝农商行	2023年1月6日-2023年1月13日	3.53	901,900	3,183,707.00
57	300568	星源材质	2023年1月6日-2023年1月13日	21.26	149,300	3,174,118.00
58	600873	梅花生物	2023年1月6日-2023年1月13日	10.18	310,600	3,161,908.00
59	002185	华天科技	2023年1月6日-2023年1月13日	8.29	373,600	3,097,144.00
60	603456	九洲药业	2023年1月6日-2023年1月13日	42.43	72,900	3,093,147.00
61	002138	顺络电子	2023年1月6日-2023年1月13日	26.18	117,500	3,076,150.00
62	603816	顾家家居	2023年1月6日-2023年1月13日	42.71	71,800	3,066,578.00
63	600160	巨化股份	2023年1月6日-2023年1月13日	15.51	196,800	3,052,368.00
64	603589	口子窖	2023年1月6日-2023年1月13日	57.67	52,500	3,027,675.00
65	601128	常熟银行	2023年1月6日-2023年1月13日	7.55	399,700	3,017,735.00
66	000783	长江证券	2023年1月6日-2023年1月13日	5.33	565,000	3,011,450.00
67	600153	建发股份	2023年1月6日-2023年1月13日	13.65	219,100	2,990,715.00
68	688099	晶晨股份	2023年1月6日-2023年1月13日	70.51	42,200	2,975,522.00
69	002192	融捷股份	2023年1月6日-2023年1月13日	97.90	30,300	2,966,370.00
70	000629	钒钛股份	2023年1月6日-2023年1月13日	4.73	626,400	2,962,872.00
71	300357	我武生物	2023年1月6日-2023年1月13日	55.10	53,500	2,947,850.00
72	605358	立昂微	2023年1月6日-2023年1月13日	42.60	69,000	2,939,400.00

73	601699	潞安环能	2023年1月6日-2023年1月13日	16.85	174,400	2,938,640.00
74	000683	远兴能源	2023年1月6日-2023年1月13日	7.84	369,900	2,900,016.00
75	601162	天风证券	2023年1月6日-2023年1月13日	2.87	1,009,600	2,897,552.00
76	601607	上海医药	2023年1月6日-2023年1月13日	17.83	161,900	2,886,677.00
77	603596	伯特利	2023年1月6日-2023年1月13日	79.80	35,900	2,864,820.00
78	600392	盛和资源	2023年1月6日-2023年1月13日	14.00	204,600	2,864,400.00
79	688567	孚能科技	2023年1月6日-2023年1月13日	27.03	105,900	2,862,477.00
80	002568	百润股份	2023年1月6日-2023年1月13日	37.36	76,600	2,861,776.00
81	600161	天坛生物	2023年1月6日-2023年1月13日	23.73	120,000	2,847,600.00
82	000932	华菱钢铁	2023年1月6日-2023年1月13日	4.70	604,800	2,842,560.00
83	600109	国金证券	2023年1月6日-2023年1月13日	8.70	326,200	2,837,940.00
84	601168	西部矿业	2023年1月6日-2023年1月13日	10.20	278,100	2,836,620.00
85	600521	华海药业	2023年1月6日-2023年1月13日	21.86	129,600	2,833,056.00
86	600499	科达制造	2023年1月6日-2023年1月13日	14.21	199,000	2,827,790.00
87	600486	扬农化工	2023年1月6日-2023年1月13日	103.90	27,200	2,826,080.00
88	000831	中国稀土	2023年1月6日-2023年1月13日	32.88	85,700	2,817,816.00
89	600027	华电国际	2023年1月6日-2023年1月13日	5.88	475,300	2,794,764.00
90	002223	鱼跃医疗	2023年1月6日-2023年1月13日	31.86	87,600	2,790,936.00
91	002797	第一创业	2023年1月6日-2023年1月13日	5.63	490,000	2,758,700.00
92	603077	和邦生物	2023年1月6日-2023年1月13日	3.04	900,000	2,736,000.00
93	600862	中航高科	2023年1月6日-2023年1月13日	22.29	121,800	2,714,922.00
94	002078	太阳纸业	2023年1月6日-2023年1月13日	11.52	234,700	2,703,744.00

95	688385	复旦微电	2023年1月6日-2023年1月13日	69.81	38,700	2,701,647.00
96	000999	华润三九	2023年1月6日-2023年1月13日	46.81	57,600	2,696,256.00
97	000975	银泰黄金	2023年1月6日-2023年1月13日	11.04	242,800	2,680,512.00
98	601636	旗滨集团	2023年1月6日-2023年1月13日	11.39	234,600	2,672,094.00
99	002294	信立泰	2023年1月6日-2023年1月13日	32.85	81,300	2,670,705.00
100	601872	招商轮船	2023年1月6日-2023年1月13日	5.59	473,500	2,646,865.00
101	002268	电科网安	2023年1月6日-2023年1月13日	30.53	86,300	2,634,739.00
102	600497	驰宏锌锗	2023年1月6日-2023年1月13日	5.06	519,400	2,628,164.00
103	600143	金发科技	2023年1月6日-2023年1月13日	9.69	270,900	2,625,021.00
104	002025	航天电器	2023年1月6日-2023年1月13日	66.25	39,600	2,623,500.00
105	002532	天山铝业	2023年1月6日-2023年1月13日	7.72	338,600	2,613,992.00
106	002299	圣农发展	2023年1月6日-2023年1月13日	23.69	108,800	2,577,472.00
107	300253	卫宁健康	2023年1月6日-2023年1月13日	10.28	250,500	2,575,140.00
108	601696	中银证券	2023年1月6日-2023年1月13日	10.57	243,200	2,570,624.00
109	600177	雅戈尔	2023年1月6日-2023年1月13日	6.33	405,000	2,563,650.00
110	601990	南京证券	2023年1月6日-2023年1月13日	7.93	322,000	2,553,460.00
111	002439	启明星辰	2023年1月6日-2023年1月13日	26.08	97,200	2,534,976.00
112	600705	中航产融	2023年1月6日-2023年1月13日	3.28	771,600	2,530,848.00
113	002624	完美世界	2023年1月6日-2023年1月13日	12.72	198,200	2,521,104.00
114	000591	太阳能	2023年1月6日-2023年1月13日	7.33	341,900	2,506,127.00
115	603737	三棵树	2023年1月6日-2023年1月13日	113.83	22,000	2,504,260.00
116	600348	华阳股份	2023年1月6日-2023年1月13日	14.25	175,200	2,496,600.00

117	002850	科达利	2023年1月6日-2023年 1月13日	118.81	21,000	2,495,010 .00
118	000998	隆平高科	2023年1月6日-2023年 1月13日	16.07	153,600	2,468,352 .00
119	000738	航发控制	2023年1月6日-2023年 1月13日	25.64	95,800	2,456,312 .00
120	600026	中远海能	2023年1月6日-2023年 1月13日	12.05	202,800	2,443,740 .00
121	688301	奕瑞科技	2023年1月6日-2023年 1月13日	457.88	5,300	2,426,764 .00
122	600549	厦门钨业	2023年1月6日-2023年 1月13日	19.55	124,100	2,426,155 .00
123	600258	首旅酒店	2023年1月6日-2023年 1月13日	24.80	97,700	2,422,960 .00
124	000728	国元证券	2023年1月6日-2023年 1月13日	6.33	381,600	2,415,528 .00
125	600482	中国动力	2023年1月6日-2023年 1月13日	15.29	157,600	2,409,704 .00
126	000988	华工科技	2023年1月6日-2023年 1月13日	16.41	146,500	2,404,065 .00
127	000519	中兵红箭	2023年1月6日-2023年 1月13日	19.64	121,700	2,390,188 .00
128	002273	水晶光电	2023年1月6日-2023年 1月13日	11.79	202,400	2,386,296 .00
129	002673	西部证券	2023年1月6日-2023年 1月13日	6.09	391,000	2,381,190 .00
130	300604	长川科技	2023年1月6日-2023年 1月13日	44.58	52,800	2,353,824 .00
131	601997	贵阳银行	2023年1月6日-2023年 1月13日	5.49	426,600	2,342,034 .00
132	002507	涪陵榨菜	2023年1月6日-2023年 1月13日	25.77	90,400	2,329,608 .00
133	300136	信维通信	2023年1月6日-2023年 1月13日	16.51	141,000	2,327,910 .00
134	300832	新产业	2023年1月6日-2023年 1月13日	50.14	45,700	2,291,398 .00
135	300363	博腾股份	2023年1月6日-2023年 1月13日	40.85	55,600	2,271,260 .00
136	002092	中泰化学	2023年1月6日-2023年 1月13日	7.46	303,600	2,264,856 .00
137	002430	杭氧股份	2023年1月6日-2023年 1月13日	39.36	57,500	2,263,200 .00
138	000703	恒逸石化	2023年1月6日-2023年 1月13日	7.03	320,500	2,253,115 .00

139	600325	华发股份	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	9.06	246,500	2,233,290 .00
140	002030	达安基因	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	15.56	143,400	2,231,304 .00
141	002739	万达电影	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	14.00	158,900	2,224,600 .00
142	002056	横店东磁	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	18.74	118,400	2,218,816 .00
143	002557	洽洽食品	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	50.00	44,300	2,215,000 .00
144	300308	中际旭创	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	27.03	81,700	2,208,351 .00
145	603233	大参林	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	39.60	55,500	2,197,800 .00
146	600529	山东药玻	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	28.40	77,200	2,192,480 .00
147	601666	平煤股份	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	10.81	202,500	2,189,025 .00
148	600704	物产中大	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	4.81	454,200	2,184,702 .00
149	601198	东兴证券	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	7.72	282,700	2,182,444 .00
150	000729	燕京啤酒	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	10.62	205,500	2,182,410 .00
151	002465	海格通信	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	8.12	268,400	2,179,408 .00
152	002156	通富微电	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	16.48	132,200	2,178,656 .00
153	601016	节能风电	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	3.81	569,000	2,167,890 .00
154	600655	豫园股份	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	7.61	284,300	2,163,523 .00
155	600879	航天电子	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	6.80	317,200	2,156,960 .00
156	300088	长信科技	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	5.97	357,900	2,136,663 .00
157	603267	鸿远电子	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	101.16	21,000	2,124,360 .00
158	603658	安图生物	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	61.85	34,200	2,115,270 .00
159	600415	小商品城	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	5.24	400,200	2,097,048 .00
160	002080	中材科技	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	21.43	97,800	2,095,854 .00

161	002409	雅克科技	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	50.37	41,600	2,095,392 .00
162	600546	山煤国际	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	14.49	144,400	2,092,356 .00
163	688116	天奈科技	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	77.14	27,100	2,090,494 .00
164	002353	杰瑞股份	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	27.91	74,800	2,087,668 .00
165	000830	鲁西化工	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	12.39	168,000	2,081,520 .00
166	002683	广东宏大	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	26.96	76,400	2,059,744 .00
167	000960	锡业股份	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	14.10	146,000	2,058,600 .00
168	000400	许继电气	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	19.97	103,000	2,056,910 .00
169	000878	云南铜业	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	11.75	175,000	2,056,250 .00
170	600516	方大炭素	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	6.12	332,700	2,036,124 .00
171	000623	吉林敖东	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	14.99	135,600	2,032,644 .00
172	600170	上海建工	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	2.60	780,100	2,028,260 .00
173	603160	汇顶科技	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	50.20	40,100	2,013,020 .00
174	600038	中直股份	2023 年 1 月 10 日	46.41	43,100	2,000,271 .00
175	002444	巨星科技	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	18.98	105,200	1,996,696 .00
176	002531	天顺风能	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	15.13	131,600	1,991,108 .00
177	300017	网宿科技	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	5.58	355,400	1,983,132 .00
178	600637	东方明珠	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	6.65	298,200	1,983,030 .00
179	300418	昆仑万维	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	14.41	137,600	1,982,816 .00
180	601577	长沙银行	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	6.76	293,300	1,982,708 .00
181	002372	伟星新材	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	21.34	92,700	1,978,218 .00
182	600166	福田汽车	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	2.81	700,900	1,969,529 .00



183	600739	辽宁成大	2023年1月6日-2023年1月13日	12.59	156,200	1,966,558.00
184	600642	申能股份	2023年1月6日-2023年1月13日	5.49	357,500	1,962,675.00
185	603712	七一二	2023年1月6日-2023年1月13日	34.92	56,200	1,962,504.00
186	300373	扬杰科技	2023年1月6日-2023年1月13日	52.60	37,300	1,961,980.00
187	600699	均胜电子	2023年1月6日-2023年1月13日	14.05	139,600	1,961,380.00
188	603026	胜华新材	2023年1月6日-2023年1月13日	92.30	21,200	1,956,760.00
189	601456	国联证券	2023年1月6日-2023年1月13日	11.25	173,800	1,955,250.00
190	002326	永太科技	2023年1月6日-2023年1月13日	21.83	89,400	1,951,602.00
191	002203	海亮股份	2023年1月6日-2023年1月13日	11.30	172,200	1,945,860.00
192	688002	睿创微纳	2023年1月6日-2023年1月13日	37.19	52,000	1,933,880.00
193	000970	中科三环	2023年1月6日-2023年1月13日	13.64	141,600	1,931,424.00
194	603127	昭衍新药	2023年1月6日-2023年1月13日	58.41	32,900	1,921,689.00
195	002508	老板电器	2023年1月6日-2023年1月13日	27.76	69,100	1,918,216.00
196	000155	川能动力	2023年1月6日-2023年1月13日	17.84	107,500	1,917,800.00
197	600673	东阳光	2023年1月6日-2023年1月13日	8.69	220,000	1,911,800.00
198	600380	健康元	2023年1月6日-2023年1月13日	11.29	168,800	1,905,752.00
199	689009	九号公司	2023年1月6日-2023年1月13日	30.49	62,400	1,902,576.00
200	000039	中集集团	2023年1月6日-2023年1月13日	7.04	268,300	1,888,832.00
201	600909	华安证券	2023年1月6日-2023年1月13日	4.59	410,700	1,885,113.00
202	600056	中国医药	2023年1月6日-2023年1月13日	17.23	109,200	1,881,516.00
203	300676	华大基因	2023年1月6日-2023年1月13日	51.69	36,200	1,871,178.00
204	600867	通化东宝	2023年1月6日-2023年1月13日	9.18	203,500	1,868,130.00

205	600118	中国卫星	2023年1月6日-2023年1月13日	21.55	86,200	1,857,610.00
206	002065	东华软件	2023年1月6日-2023年1月13日	5.66	327,500	1,853,650.00
207	600985	淮北矿业	2023年1月6日-2023年1月13日	12.80	144,600	1,850,880.00
208	000750	国海证券	2023年1月6日-2023年1月13日	3.33	555,800	1,850,814.00
209	000739	普洛药业	2023年1月6日-2023年1月13日	21.54	85,900	1,850,286.00
210	300244	迪安诊断	2023年1月6日-2023年1月13日	25.13	73,100	1,837,003.00
211	300058	蓝色光标	2023年1月6日-2023年1月13日	5.05	362,600	1,831,130.00
212	600008	首创环保	2023年1月6日-2023年1月13日	2.83	641,900	1,816,577.00
213	600369	西南证券	2023年1月6日-2023年1月13日	3.75	483,400	1,812,750.00
214	688009	中国通号	2023年1月6日-2023年1月13日	4.79	377,100	1,806,309.00
215	002152	广电运通	2023年1月6日-2023年1月13日	9.94	181,000	1,799,140.00
216	300474	景嘉微	2023年1月6日-2023年1月13日	54.57	32,900	1,795,353.00
217	600372	中航电子	2023年1月6日-2023年1月13日	15.97	112,400	1,795,028.00
218	002831	裕同科技	2023年1月6日-2023年1月13日	33.07	54,200	1,792,394.00
219	300558	贝达药业	2023年1月6日-2023年1月13日	49.27	36,300	1,788,501.00
220	601880	辽港股份	2023年1月6日-2023年1月13日	1.62	1,099,300	1,780,866.00
221	600998	九州通	2023年1月6日-2023年1月13日	13.04	136,500	1,779,960.00
222	000513	丽珠集团	2023年1月6日-2023年1月13日	32.48	54,600	1,773,408.00
223	000027	深圳能源	2023年1月6日-2023年1月13日	6.36	277,900	1,767,444.00
224	600435	北方导航	2023年1月6日-2023年1月13日	11.60	152,300	1,766,680.00
225	002936	郑州银行	2023年1月6日-2023年1月13日	2.35	748,700	1,759,445.00
226	300866	安克创新	2023年1月6日-2023年1月13日	59.27	29,600	1,754,392.00

227	000547	航天发展	2023年1月6日-2023年1月13日	9.39	186,800	1,754,052.00
228	002408	齐翔腾达	2023年1月6日-2023年1月13日	7.04	248,800	1,751,552.00
229	300070	碧水源	2023年1月6日-2023年1月13日	4.73	370,000	1,750,100.00
230	000636	风华高科	2023年1月6日-2023年1月13日	14.83	118,000	1,749,940.00
231	300026	红日药业	2023年1月6日-2023年1月13日	5.68	307,000	1,743,760.00
232	002131	利欧股份	2023年1月6日-2023年1月13日	1.77	984,000	1,741,680.00
233	002506	协鑫集成	2023年1月6日-2023年1月13日	2.91	596,700	1,736,397.00
234	002926	华西证券	2023年1月6日-2023年1月13日	7.53	229,500	1,728,135.00
235	002212	天融信	2023年1月6日-2023年1月13日	9.99	172,700	1,725,273.00
236	603883	老百姓	2023年1月6日-2023年1月13日	40.47	42,600	1,724,022.00
237	300383	光环新网	2023年1月6日-2023年1月13日	8.16	209,600	1,710,336.00
238	600378	昊华科技	2023年1月6日-2023年1月13日	42.91	39,800	1,707,818.00
239	002183	怡亚通	2023年1月6日-2023年1月13日	6.43	264,900	1,703,307.00
240	300682	朗新科技	2023年1月6日-2023年1月13日	21.98	77,400	1,701,252.00
241	600820	隧道股份	2023年1月6日-2023年1月13日	5.27	321,400	1,693,778.00
242	603858	步长制药	2023年1月6日-2023年1月13日	21.01	80,600	1,693,406.00
243	002572	索菲亚	2023年1月6日-2023年1月13日	18.16	93,200	1,692,512.00
244	600271	航天信息	2023年1月6日-2023年1月13日	10.41	162,000	1,686,420.00
245	002195	二三四五	2023年1月6日-2023年1月13日	2.01	836,000	1,680,360.00
246	600580	卧龙电驱	2023年1月6日-2023年1月13日	12.46	134,200	1,672,132.00
247	002250	联化科技	2023年1月6日-2023年1月13日	15.50	107,700	1,669,350.00
248	300296	利亚德	2023年1月6日-2023年1月13日	5.66	294,800	1,668,568.00

249	002500	山西证 券	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	5.30	314,500	1,666,850 .00
250	600848	上海临 港	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	11.92	139,800	1,666,416 .00
251	603893	瑞芯微	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	68.81	24,200	1,665,202 .00
252	600390	五矿资 本	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	5.08	327,700	1,664,716 .00
253	600863	内蒙华 电	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	3.49	476,300	1,662,287 .00
254	000887	中鼎股 份	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	14.47	114,800	1,661,156 .00
255	002368	太极股 份	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	28.13	59,000	1,659,670 .00
256	603156	养元饮 品	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	22.27	73,800	1,643,526 .00
257	600021	上海电 力	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	10.01	164,100	1,642,641 .00
258	002958	青农商 行	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	2.89	567,700	1,640,653 .00
259	688779	长远锂 科	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	14.59	112,400	1,639,916 .00
260	688538	和辉光 电	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	2.68	608,100	1,629,708 .00
261	601958	金铂股 份	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	11.55	141,100	1,629,705 .00
262	300024	机器人	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	8.98	180,700	1,622,686 .00
263	300001	特锐德	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	15.21	106,400	1,618,344 .00
264	600755	厦门国 贸	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	7.14	224,300	1,601,502 .00
265	002244	滨江集 团	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	8.83	181,200	1,599,996 .00
266	688521	芯原股 份	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	44.07	36,300	1,599,741 .00
267	300009	安科生 物	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	9.36	170,900	1,599,624 .00
268	600208	新湖中 宝	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	2.54	628,000	1,595,120 .00
269	688256	寒武纪	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	54.56	29,200	1,593,152 .00
270	002155	湖南黄 金	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	12.95	122,500	1,586,375 .00

271	600316	洪都航空	2023年1月6日-2023年1月13日	25.19	62,600	1,576,894.00
272	600315	上海家化	2023年1月6日-2023年1月13日	31.85	49,400	1,573,390.00
273	002511	中顺洁柔	2023年1月6日-2023年1月13日	13.74	114,500	1,573,230.00
274	603885	吉祥航空	2023年1月6日-2023年1月13日	16.18	96,800	1,566,224.00
275	000997	新大陆	2023年1月6日-2023年1月13日	13.01	120,300	1,565,103.00
276	601231	环旭电子	2023年1月6日-2023年1月13日	16.23	96,300	1,562,949.00
277	300776	帝尔激光	2023年1月6日-2023年1月13日	126.00	12,400	1,562,400.00
278	000060	中金岭南	2023年1月6日-2023年1月13日	4.10	380,300	1,559,230.00
279	000050	深天马A	2023年1月6日-2023年1月13日	8.66	178,800	1,548,408.00
280	600060	海信视像	2023年1月6日-2023年1月13日	13.54	114,100	1,544,914.00
281	601992	金隅集团	2023年1月6日-2023年1月13日	2.54	608,100	1,544,574.00
282	601005	重庆钢铁	2023年1月6日-2023年1月13日	1.58	976,700	1,543,186.00
283	600511	国药股份	2023年1月6日-2023年1月13日	27.90	55,100	1,537,290.00
284	603927	中科软	2023年1月6日-2023年1月13日	29.61	51,900	1,536,759.00
285	300850	新强联	2023年1月10日	53.28	28,800	1,534,464.00
286	603218	日月股份	2023年1月6日-2023年1月13日	20.30	74,700	1,516,410.00
287	601717	郑煤机	2023年1月6日-2023年1月13日	11.16	134,500	1,501,020.00
288	600528	中铁工业	2023年1月6日-2023年1月13日	7.63	194,400	1,483,272.00
289	300251	光线传媒	2023年1月6日-2023年1月13日	8.66	171,100	1,481,726.00
290	600801	华新水泥	2023年1月6日-2023年1月13日	14.82	99,300	1,471,626.00
291	600201	生物股份	2023年1月6日-2023年1月13日	9.01	163,100	1,469,531.00
292	002939	长城证券	2023年1月6日-2023年1月13日	8.28	176,600	1,462,248.00

293	600566	济川药业	2023年1月6日-2023年1月13日	27.22	53,700	1,461,714.00
294	688185	康希诺	2023年1月6日-2023年1月13日	146.02	10,000	1,460,200.00
295	300168	万达信息	2023年1月6日-2023年1月13日	8.43	173,100	1,459,233.00
296	000021	深科技	2023年1月6日-2023年1月13日	10.69	136,400	1,458,116.00
297	600066	宇通客车	2023年1月6日-2023年1月13日	7.51	193,700	1,454,687.00
298	000825	太钢不锈	2023年1月6日-2023年1月13日	4.32	334,500	1,445,040.00
299	600171	上海贝岭	2023年1月6日-2023年1月13日	17.43	82,900	1,444,947.00
300	002373	千方科技	2023年1月6日-2023年1月13日	8.92	160,900	1,435,228.00
301	600906	财达证券	2023年1月6日-2023年1月13日	7.57	189,200	1,432,244.00
302	600598	北大荒	2023年1月6日-2023年1月13日	13.76	103,600	1,425,536.00
303	600839	四川长虹	2023年1月6日-2023年1月13日	2.64	537,000	1,417,680.00
304	300677	英科医疗	2023年1月6日-2023年1月13日	21.03	67,400	1,417,422.00
305	600827	百联股份	2023年1月6日-2023年1月13日	12.12	116,700	1,414,404.00
306	600282	南钢股份	2023年1月6日-2023年1月13日	3.15	448,700	1,413,405.00
307	600535	天士力	2023年1月6日-2023年1月13日	10.76	131,200	1,411,712.00
308	600970	中材国际	2023年1月6日-2023年1月13日	8.52	165,000	1,405,800.00
309	601866	中远海发	2023年1月6日-2023年1月13日	2.42	577,000	1,396,340.00
310	601778	晶科科技	2023年1月6日-2023年1月13日	5.50	253,600	1,394,800.00
311	601665	齐鲁银行	2023年1月6日-2023年1月13日	4.17	333,500	1,390,695.00
312	600500	中化国际	2023年1月6日-2023年1月13日	6.61	209,200	1,382,812.00
313	002128	电投能源	2023年1月6日-2023年1月13日	12.34	111,900	1,380,846.00
314	002127	南极电商	2023年1月6日-2023年1月13日	4.81	286,500	1,378,065.00

315	300861	美畅股份	2023年1月6日-2023年1月13日	49.16	28,000	1,376,480.00
316	002153	石基信息	2023年1月6日-2023年1月13日	14.99	91,800	1,376,082.00
317	601179	中国西电	2023年1月6日-2023年1月13日	4.61	298,400	1,375,624.00
318	603568	伟明环保	2023年1月6日-2023年1月13日	18.53	74,100	1,373,073.00
319	688188	柏楚电子	2023年1月6日-2023年1月13日	217.08	6,300	1,367,604.00
320	000930	中粮科技	2023年1月6日-2023年1月13日	8.36	163,200	1,364,352.00
321	000709	河钢股份	2023年1月6日-2023年1月13日	2.26	602,700	1,362,102.00
322	603000	人民网	2023年1月6日-2023年1月13日	16.87	80,700	1,361,409.00
323	600498	烽火通信	2023年1月6日-2023年1月13日	13.14	103,600	1,361,304.00
324	002595	豪迈科技	2023年1月6日-2023年1月13日	23.15	58,200	1,347,330.00
325	000012	南玻A	2023年1月6日-2023年1月13日	6.71	200,100	1,342,671.00
326	300182	捷成股份	2023年1月6日-2023年1月13日	4.47	300,000	1,341,000.00
327	300888	稳健医疗	2023年1月6日-2023年1月13日	71.50	18,700	1,337,050.00
328	600398	海澜之家	2023年1月6日-2023年1月13日	5.30	251,200	1,331,360.00
329	002701	奥瑞金	2023年1月6日-2023年1月13日	5.05	262,200	1,324,110.00
330	002019	亿帆医药	2023年1月6日-2023年1月13日	12.25	107,400	1,315,650.00
331	000987	越秀资本	2023年1月6日-2023年1月13日	5.99	219,000	1,311,810.00
332	002124	天邦食品	2023年1月6日-2023年1月13日	6.11	214,600	1,311,206.00
333	002985	北摩高科	2023年1月6日-2023年1月13日	45.10	29,000	1,307,900.00
334	002396	星网锐捷	2023年1月6日-2023年1月13日	19.16	68,000	1,302,880.00
335	000581	威孚高科	2023年1月6日-2023年1月13日	17.73	73,300	1,299,609.00
336	600959	江苏有线	2023年1月6日-2023年1月13日	2.97	437,500	1,299,375.00

337	600895	张江高科	2023年1月6日-2023年 1月13日	11.34	112,700	1,278,018 .00
338	603707	健友股份	2023年1月6日-2023年 1月13日	18.04	70,800	1,277,232 .00
339	000401	冀东水泥	2023年1月6日-2023年 1月13日	8.23	155,100	1,276,473 .00
340	000598	兴蓉环境	2023年1月6日-2023年 1月13日	4.89	260,700	1,274,823 .00
341	000778	新兴铸管	2023年1月6日-2023年 1月13日	3.65	348,600	1,272,390 .00
342	300618	寒锐钴业	2023年1月6日-2023年 1月13日	40.05	31,600	1,265,580 .00
343	300115	长盈精密	2023年1月6日-2023年 1月13日	10.33	122,300	1,263,359 .00
344	600582	天地科技	2023年1月6日-2023年 1月13日	5.20	241,400	1,255,280 .00
345	002670	国盛金控	2023年1月6日-2023年 1月13日	7.41	169,100	1,253,031 .00
346	688208	道通科技	2023年1月6日-2023年 1月13日	31.55	39,600	1,249,380 .00
347	600663	陆家嘴	2023年1月6日-2023年 1月13日	9.74	128,000	1,246,720 .00
348	002249	大洋电机	2023年1月6日-2023年 1月13日	5.12	242,900	1,243,648 .00
349	600297	广汇汽车	2023年1月6日-2023年 1月13日	2.10	592,200	1,243,620 .00
350	600718	东软集团	2023年1月6日-2023年 1月13日	9.95	124,700	1,240,765 .00
351	300482	万孚生物	2023年1月6日-2023年 1月13日	31.87	38,900	1,239,743 .00
352	002690	美亚光电	2023年1月6日-2023年 1月13日	23.90	51,500	1,230,850 .00
353	600507	方大特钢	2023年1月6日-2023年 1月13日	6.02	203,800	1,226,876 .00
354	002266	浙富控股	2023年1月6日-2023年 1月13日	3.91	312,500	1,221,875 .00
355	688690	纳微科技	2023年1月6日-2023年 1月13日	51.77	23,500	1,216,595 .00
356	600329	达仁堂	2023年1月6日-2023年 1月13日	29.10	41,800	1,216,380 .00
357	600517	国网英大	2023年1月6日-2023年 1月13日	4.84	250,700	1,213,388 .00
358	603225	新风鸣	2023年1月6日-2023年 1月13日	10.88	111,400	1,212,032 .00



359	000883	湖北能源	2023年1月6日-2023年1月13日	4.20	287,400	1,207,080.00
360	002505	鹏都农牧	2023年1月6日-2023年1月13日	2.58	464,300	1,197,894.00
361	603866	桃李面包	2023年1月6日-2023年1月13日	15.40	77,600	1,195,040.00
362	600409	三友化工	2023年1月6日-2023年1月13日	6.61	180,500	1,193,105.00
363	000656	金科股份	2023年1月6日-2023年1月13日	1.91	624,600	1,192,986.00
364	300212	易华录	2023年1月6日-2023年1月13日	20.41	58,300	1,189,903.00
365	600259	广晟有色	2023年1月6日-2023年1月13日	40.20	29,500	1,185,900.00
366	600022	山东钢铁	2023年1月6日-2023年1月13日	1.48	798,700	1,182,076.00
367	601000	唐山港	2023年1月6日-2023年1月13日	2.74	431,400	1,182,036.00
368	002002	鸿达兴业	2023年1月6日-2023年1月13日	3.24	364,000	1,179,360.00
369	600871	石化油服	2023年1月6日-2023年1月13日	1.98	592,400	1,172,952.00
370	000089	深圳机场	2023年1月6日-2023年1月13日	7.86	149,100	1,171,926.00
371	601106	中国一重	2023年1月6日-2023年1月13日	2.93	399,600	1,170,828.00
372	600567	山鹰国际	2023年1月6日-2023年1月13日	2.48	471,400	1,169,072.00
373	600064	南京高科	2023年1月6日-2023年1月13日	6.61	176,700	1,167,987.00
374	300376	易事特	2023年1月6日-2023年1月13日	6.83	169,700	1,159,051.00
375	600216	浙江医药	2023年1月6日-2023年1月13日	11.69	98,800	1,154,972.00
376	002468	申通快递	2023年1月6日-2023年1月13日	10.33	111,700	1,153,861.00
377	002429	兆驰股份	2023年1月6日-2023年1月13日	3.49	330,000	1,151,700.00
378	600782	新钢股份	2023年1月6日-2023年1月13日	4.09	278,700	1,139,883.00
379	002081	金螳螂	2023年1月6日-2023年1月13日	4.85	231,700	1,123,745.00
380	601333	广深铁路	2023年1月6日-2023年1月13日	2.27	494,100	1,121,607.00

381	601718	际华集团	2023年1月6日-2023年1月13日	2.91	384,100	1,117,731.00
382	688029	南微医学	2023年1月6日-2023年1月13日	82.13	13,500	1,108,755.00
383	600667	太极实业	2023年1月6日-2023年1月13日	5.16	214,700	1,107,852.00
384	601118	海南橡胶	2023年1月6日-2023年1月13日	4.38	250,100	1,095,438.00
385	002010	传化智联	2023年1月6日-2023年1月13日	5.34	204,300	1,090,962.00
386	002191	劲嘉股份	2023年1月6日-2023年1月13日	7.23	150,200	1,085,946.00
387	600062	华润双鹤	2023年1月6日-2023年1月13日	17.89	60,600	1,084,134.00
388	600728	佳都科技	2023年1月6日-2023年1月13日	5.28	204,800	1,081,344.00
389	600737	中粮糖业	2023年1月6日-2023年1月13日	6.94	155,800	1,081,252.00
390	300463	迈克生物	2023年1月6日-2023年1月13日	17.30	62,400	1,079,520.00
391	000540	中天金融	2023年1月6日-2023年1月13日	1.51	714,400	1,078,744.00
392	000537	广宇发展	2023年1月6日-2023年1月13日	13.23	81,500	1,078,245.00
393	600597	光明乳业	2023年1月6日-2023年1月13日	10.76	100,200	1,078,152.00
394	600376	首开股份	2023年1月6日-2023年1月13日	5.69	188,400	1,071,996.00
395	600155	华创阳安	2023年1月6日-2023年1月13日	6.50	164,600	1,069,900.00
396	601156	东航物流	2023年1月6日-2023年1月13日	15.26	69,500	1,060,570.00
397	002221	东华能源	2023年1月6日-2023年1月13日	7.63	137,800	1,051,414.00
398	002745	木林森	2023年1月6日-2023年1月13日	8.11	129,500	1,050,245.00
399	600131	国网信通	2023年1月6日-2023年1月13日	14.96	70,100	1,048,696.00
400	601098	中南传媒	2023年1月6日-2023年1月13日	9.98	104,800	1,045,904.00
401	300072	海新能科	2023年1月6日-2023年1月13日	4.36	239,600	1,044,656.00
402	600967	内蒙一机	2023年1月6日-2023年1月13日	8.26	124,700	1,030,022.00

403	002416	爱施德	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	9.48	108,400	1,027,632 .00
404	600126	杭钢股 份	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	4.13	246,100	1,016,393 .00
405	603379	三美股 份	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	28.46	35,700	1,016,022 .00
406	601991	大唐发 电	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	2.79	362,300	1,010,817 .00
407	000156	华数传 媒	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	7.49	134,800	1,009,652 .00
408	603228	景旺电 子	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	20.24	49,300	997,832.0 0
409	600808	马钢股 份	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	2.81	353,600	993,616.0 0
410	002048	宁波华 翔	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	13.90	71,100	988,290.0 0
411	000937	冀中能 源	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	6.36	154,500	982,620.0 0
412	601568	北元集 团	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	5.67	173,100	981,477.0 0
413	002281	光迅科 技	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	15.72	61,000	958,920.0 0
414	600901	江苏租 赁	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	5.48	174,300	955,164.0 0
415	001914	招商积 余	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	15.38	61,900	952,022.0 0
416	600373	中文传 媒	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	9.57	99,000	947,430.0 0
417	600095	湘财股 份	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	7.56	124,700	942,732.0 0
418	300630	普利制 药	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	24.66	38,200	942,012.0 0
419	688289	圣湘生 物	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	21.95	42,900	941,655.0 0
420	003035	南网能 源	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	5.67	165,900	940,653.0 0
421	000559	万向钱 潮	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	4.87	192,600	937,962.0 0
422	603056	德邦股 份	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	20.83	44,900	935,267.0 0
423	000898	鞍钢股 份	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	2.67	348,800	931,296.0 0
424	002434	万里扬	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	8.05	115,100	926,555.0 0

425	301029	怡合达	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	65.74	14,000	920,360.0 0
426	000402	金融街	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	5.25	173,900	912,975.0 0
427	603317	天味食品	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	27.48	33,200	912,336.0 0
428	002867	周大生	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	14.03	63,800	895,114.0 0
429	600556	天下秀	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	6.74	131,800	888,332.0 0
430	601598	中国外运	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	3.84	230,500	885,120.0 0
431	601928	凤凰传媒	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	7.92	111,600	883,872.0 0
432	601611	中国核建	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	7.60	116,100	882,360.0 0
433	601608	中信重工	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	3.49	252,700	881,923.0 0
434	000563	陕国投 A	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	3.03	288,700	874,761.0 0
435	300257	开山股份	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	15.00	57,800	867,000.0 0
436	002948	青岛银行	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	3.36	257,400	864,864.0 0
437	600707	彩虹股份	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	4.14	208,900	864,846.0 0
438	600195	中牧股份	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	11.62	74,400	864,528.0 0
439	000959	首钢股份	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	3.77	227,200	856,544.0 0
440	600968	海油发展	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	2.88	295,900	852,192.0 0
441	000967	盈峰环境	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	4.54	185,800	843,532.0 0
442	600167	联美控股	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	6.32	133,400	843,088.0 0
443	002110	三钢闽光	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	4.70	178,800	840,360.0 0
444	603868	飞科电器	2023 年 1 月 6 日	67.33	12,000	807,960.0 0
445	002705	新宝股份	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	16.65	48,400	805,860.0 0
446	603650	彤程新材	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	30.83	26,100	804,663.0 0

447	000415	渤海租赁	2023年1月6日-2023年1月13日	2.21	360,700	797,147.00
448	000990	诚志股份	2023年1月6日-2023年1月13日	8.80	88,700	780,560.00
449	688006	杭可科技	2023年1月6日-2023年1月13日	43.77	17,700	774,729.00
450	300869	康泰医学	2023年1月6日-2023年1月13日	32.57	23,400	762,138.00
451	002925	盈趣科技	2023年1月6日-2023年1月13日	16.52	45,500	751,660.00
452	600307	酒钢宏兴	2023年1月6日-2023年1月13日	1.65	455,200	751,080.00
453	002242	九阳股份	2023年1月6日-2023年1月13日	16.48	44,800	738,304.00
454	601828	美凯龙	2023年1月6日-2023年1月13日	4.69	157,400	738,206.00
455	603719	良品铺子	2023年1月6日-2023年1月13日	36.87	20,000	737,400.00
456	603638	艾迪精密	2023年1月6日-2023年1月13日	14.92	49,200	734,064.00
457	600339	中油工程	2023年1月6日-2023年1月13日	2.98	244,900	729,802.00
458	688819	天能股份	2023年1月6日-2023年1月13日	36.74	19,800	727,452.00
459	600764	中国海防	2023年1月6日-2023年1月13日	22.96	31,200	716,352.00
460	000031	大悦城	2023年1月6日-2023年1月13日	3.76	187,700	705,752.00
461	002653	海思科	2023年1月6日-2023年1月13日	22.25	31,600	703,100.00
462	002399	海普瑞	2023年1月6日-2023年1月13日	12.85	54,500	700,325.00
463	600623	华谊集团	2023年1月6日-2023年1月13日	6.32	110,200	696,464.00
464	002146	荣盛发展	2023年1月6日-2023年1月13日	2.17	316,700	687,239.00
465	600928	西安银行	2023年1月6日-2023年1月13日	3.52	193,900	682,528.00
466	688088	虹软科技	2023年1月6日-2023年1月13日	22.51	29,700	668,547.00
467	601969	海南矿业	2023年1月6日-2023年1月13日	7.41	89,200	660,972.00
468	601869	长飞光纤	2023年1月6日-2023年1月13日	32.63	20,000	652,600.00

469	600648	外高桥	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	11.95	54,300	648,885.0 0
470	600006	东风汽 车	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	5.58	116,000	647,280.0 0
471	600787	中储股 份	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	4.97	127,400	633,178.0 0
472	000869	张 裕 A	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	30.24	20,700	625,968.0 0
473	002563	森马服 饰	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	5.24	117,600	616,224.0 0
474	000961	中南建 设	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	2.19	279,100	611,229.0 0
475	600377	宁沪高 速	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	8.22	71,900	591,018.0 0
476	000553	安道麦 A	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	9.05	63,500	574,675.0 0
477	601298	青岛港	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	5.61	102,200	573,342.0 0
478	603355	莱克电 气	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	28.04	20,000	560,800.0 0
479	600350	山东高 速	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	5.69	98,400	559,896.0 0
480	000062	深圳华 强	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	12.21	45,700	557,997.0 0
481	601139	深圳燃 气	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	6.54	84,200	550,668.0 0
482	002945	华林证 券	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	13.18	39,300	517,974.0 0
483	002901	大博医 疗	2023 年 1 月 6 日	34.03	15,000	510,450.0 0
484	001872	招商港 口	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	14.36	34,000	488,240.0 0
485	601228	广州港	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	3.15	153,000	481,950.0 0
486	600299	安迪苏	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	8.26	58,200	480,732.0 0
487	601158	重庆水 务	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	5.13	84,000	430,920.0 0
488	600956	新天绿 能	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	9.64	44,600	429,944.0 0
489	300741	华宝股 份	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	23.53	17,800	418,834.0 0
490	600917	重庆燃 气	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	7.96	45,900	365,364.0 0

491	600032	浙江新能	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	11.49	30,300	348,147.00
492	688772	珠海冠宇	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 13 日	18.64	16,500	307,560.00
合计	-	-	-	-	98,206,000	921,890,033.00

注：出借证券中如有其他流通受限的情况详见本报告“本基金持有的流通受限证券”部分内容。

#### 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，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动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。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及基金投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是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的最小化。本基金的基金管理人按照法律法规和中国证监会的规定，建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构，建立健全内部控制机制和 risk 管理制度，坚持审慎经营理念，保护投资者利益和公司合法权益。

公司建立包括董事会、管理层、各部门及一线员工组成的四道风控防线，还有董事会风险控制与内审委员会、公司风险控制委员会、督察长及其合规管理部门、风险管理部门，评估各项风险并提出防控措施并有效执行。

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。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。

##### 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。

基金的银行存款存放在托管人和其他拥有相关资质的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均与授权的证券结算机构完成证券交收和款项清算或通过有资格

的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在场外交易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。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	248,000.00
未评级	-	-
合计	-	248,000.00

注：评级取自第三方评级机构。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

### 7.4.13.3 流动性风险

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

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照相关法规的要求对本基金组合资产的流动性



风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%。本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30% (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，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

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

#### 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					

银行存款	89,776,778.49	-	-	-	89,776,778.49
结算备付金	20,358,179.62	-	-	-	20,358,179.62
存出保证金	618,745.62	-	-	9,868,992.00	10,487,737.62
交易性金融资产	-	-	-	-8,174,750,196.18	8,174,750,196.18
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	154,000.00	154,000.00
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	237,412.12	237,412.12
资产总计	110,753,703.73	-	-	-8,185,010,600.30	8,295,764,304.03
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	36,152,652.95	36,152,652.95
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	989,578.38	989,578.38
应付托管费	-	-	-	329,859.47	329,859.47
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	23,793.66	23,793.66
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	2,825,189.28	2,825,189.28
负债总计	-	-	-	40,321,073.74	40,321,073.74
利率敏感度缺口	110,753,703.73	-	-	-8,144,689,526.56	8,255,443,230.29
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	16,855,551.78	-	-	-	16,855,551.78
结算备付金	32,975,602.17	-	-	-	32,975,602.17
存出保证金	254,879.06	-	-	12,273,744.00	12,528,623.06
交易性金融资产	-	-	248,000.00	3,600,651,564.62	3,600,899,564.62
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	31,000,000.00	-	-	-	31,000,000.00
应收清算款	-	-	-	4,722,652.91	4,722,652.91
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	1,680.00	1,680.00
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-

其他资产	-	-	-	167,434.88	167,434.88
资产总计	81,086,033.01	-	248,000.00	3,617,817,076.41	3,699,151,109.42
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	6,316,479.15	6,316,479.15
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	421,187.25	421,187.25
应付托管费	-	-	-	140,395.77	140,395.77
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	12,728.57	12,728.57
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,352,460.39	1,352,460.39
负债总计	-	-	-	8,243,251.13	8,243,251.13
利率敏感度缺口	81,086,033.01	-	248,000.00	3,609,573,825.28	3,690,907,858.29

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

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
	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（2022年12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	市场利率上升 25 个基点	-	-3,494.75
	市场利率下降 25 个基点	-	3,553.82

#### 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。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

## 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
	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（2022年12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	所有外币相对人民币升值 5%	-	-
	所有外币相对人民币贬值 5%	-	-

## 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。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、债券及基金，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。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 2022年12月31日		上年度末 2021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	8,174,750,196.18	99.02	3,600,651,564.62	97.55
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	8,174,750,196.18	99.02	3,600,651,564.62	97.55

## 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩基准以外的其他市场变量保持不变		
	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（2022年12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	业绩比较基准上升 5%	412,659,024.28	184,238,016.06
	业绩比较基准下降 5%	-412,659,024.28	-184,238,016.06

## 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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	8,143,578,347.51	3,592,785,780.60
第二层次	30,084,340.41	8,113,784.02
第三层次	1,087,508.26	-
合计	8,174,750,196.18	3,600,899,564.62

## 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，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公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	1,078,180.88	1,078,180.88
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	9,327.38	9,327.38
其中：计入损益的利得或损失	-	9,327.38	9,327.38
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,087,508.26	1,087,508.26
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	9,327.38	9,327.38
项目	上年度可比同期 2021年1月1日至2021年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	-	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益	-	-	-

的利得或损失			
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

注：1. 于 2022 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。

2. 计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	1,087,508.26	平均价格亚式期权模型	预期波动率	18.91%-247.56%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债（上年度末：无）。

#### 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以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，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

本报告中资产负债表和利润表的上期比较数据，已根据本年《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〉》中的格式要求进行列示调整。其中：

原“应收利息”、“其他资产”项目，合并列示在“其他资产”项目；

原“应付交易费用”、“应付利息”、“其他负债”项目，合并列示在“其他负债”项目；

原“交易费用”、“其他费用”项目，合并列示在“其他费用”项目。

## § 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	8,174,750,196.18	98.54
	其中：股票	8,174,750,196.18	98.54
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	110,134,958.11	1.33
8	其他各项资产	10,879,149.74	0.13
9	合计	8,295,764,304.03	100.00

注：1. 股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值；2. 通过转融通证券出借业务出借的证券公允价值为 921,890,033.00 元，占基金资产净值的比例为 11.17%。

### 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	78,247,655.10	0.95
B	采矿业	358,513,267.61	4.34
C	制造业	4,971,089,884.01	60.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	273,554,369.99	3.31
E	建筑业	72,598,888.49	0.88
F	批发和零售业	347,220,751.14	4.21
G	交通运输、仓储和邮政业	182,286,915.06	2.21
H	住宿和餐饮业	21,448,528.00	0.26
I	信息传输、软件和信息技术服务业	584,842,332.86	7.08
J	金融业	711,599,197.39	8.62
K	房地产业	168,192,977.56	2.04
L	租赁和商务服务业	95,196,910.37	1.15



M	科学研究和技术服务业	89,820,431.92	1.09
N	水利、环境和公共设施管理业	45,728,597.20	0.55
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	16,206,613.43	0.20
R	文化、体育和娱乐业	108,144,767.00	1.31
S	综合	48,904,733.39	0.59
	合计	8,173,596,820.52	99.01

### 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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	703,941.56	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	249,171.51	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	52,566.35	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	38,283.70	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	106,663.20	0.00
R	文化、体育和娱乐业	5,604.50	0.00
S	综合	-	-
	合计	1,156,230.82	0.01

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 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	002340	格林美	6,596,500	49,011,995.00	0.59
2	300012	华测检测	2,156,200	48,083,260.00	0.58
3	600157	永泰能源	28,547,100	43,677,063.00	0.53
4	002384	东山精密	1,755,644	43,417,076.12	0.53
5	688777	中控技术	450,090	40,881,674.70	0.50
6	300724	捷佳伟创	357,600	40,773,552.00	0.49
7	688122	西部超导	421,152	39,878,882.88	0.48
8	603613	国联股份	446,872	39,521,359.68	0.48
9	300003	乐普医疗	1,691,640	38,856,970.80	0.47
10	002422	科伦药业	1,455,000	38,717,550.00	0.47
11	600487	亨通光电	2,533,300	38,151,498.00	0.46
12	002385	大北农	4,254,248	37,862,807.20	0.46
13	688063	派能科技	117,653	37,137,169.45	0.45
14	603345	安井食品	227,808	36,877,559.04	0.45
15	002966	苏州银行	4,712,042	36,659,686.76	0.44
16	603606	东方电缆	532,400	36,112,692.00	0.44
17	600885	宏发股份	1,070,970	35,781,107.70	0.43
18	600765	中航重机	1,133,310	35,234,607.90	0.43
19	600079	人福医药	1,466,900	35,044,241.00	0.42
20	600096	云天化	1,652,000	34,758,080.00	0.42
21	002497	雅化集团	1,479,080	34,388,610.00	0.42
22	601555	东吴证券	5,146,470	33,606,449.10	0.41
23	600352	浙江龙盛	3,344,900	33,114,510.00	0.40
24	002625	光启技术	1,939,340	33,007,566.80	0.40
25	002407	多氟多	984,849	32,815,168.68	0.40
26	002603	以岭药业	1,072,528	32,132,938.88	0.39
27	000009	中国宝安	2,652,217	32,065,303.53	0.39
28	601058	赛轮轮胎	3,147,600	31,538,952.00	0.38
29	601233	桐昆股份	2,166,700	31,308,815.00	0.38
30	002738	中矿资源	469,020	31,264,873.20	0.38
31	603605	珀莱雅	184,511	30,901,902.28	0.37
32	600988	赤峰黄金	1,710,100	30,867,305.00	0.37
33	603688	石英股份	233,656	30,683,705.92	0.37
34	600489	中金黄金	3,736,900	30,605,211.00	0.37
35	600298	安琪酵母	670,100	30,301,922.00	0.37
36	688390	固德威	93,609	30,244,131.81	0.37
37	002028	思源电气	785,450	30,019,899.00	0.36
38	300146	汤臣倍健	1,311,548	29,929,525.36	0.36

39	601108	财通证券	4,175,200	29,727,424.00	0.36
40	000807	云铝股份	2,672,667	29,720,057.04	0.36
41	000630	铜陵有色	9,468,500	29,541,720.00	0.36
42	600536	中国软件	506,300	29,532,479.00	0.36
43	600418	江淮汽车	2,246,886	29,501,613.18	0.36
44	300073	当升科技	522,872	29,489,980.80	0.36
45	603939	益丰药房	461,830	29,483,227.20	0.36
46	300144	宋城演艺	2,016,100	29,435,060.00	0.36
47	300037	新宙邦	667,642	29,022,397.74	0.35
48	600399	抚顺特钢	2,027,300	29,010,663.00	0.35
49	600141	兴发集团	1,000,241	29,006,989.00	0.35
50	300699	光威复材	398,271	28,775,079.75	0.35
51	600859	王府井	1,020,800	28,725,312.00	0.35
52	603517	绝味食品	467,340	28,549,800.60	0.35
53	300285	国瓷材料	1,031,036	28,425,662.52	0.34
54	600563	法拉电子	175,931	28,127,848.28	0.34
55	601077	渝农商行	7,952,100	28,070,913.00	0.34
56	300568	星源材质	1,317,200	28,003,672.00	0.34
57	600873	梅花生物	2,736,100	27,853,498.00	0.34
58	300390	天华超净	491,500	27,465,020.00	0.33
59	002185	华天科技	3,295,462	27,319,379.98	0.33
60	603456	九洲药业	643,751	27,314,354.93	0.33
61	002138	顺络电子	1,035,414	27,107,138.52	0.33
62	603816	顾家家居	634,300	27,090,953.00	0.33
63	600160	巨化股份	1,733,827	26,891,656.77	0.33
64	601128	常熟银行	3,519,793	26,574,437.15	0.32
65	603589	口子窖	460,774	26,572,836.58	0.32
66	688099	晶晨股份	376,133	26,521,137.83	0.32
67	000783	长江证券	4,975,600	26,519,948.00	0.32
68	600153	建发股份	1,932,300	26,375,895.00	0.32
69	002192	融捷股份	268,000	26,237,200.00	0.32
70	000629	钒钛股份	5,521,972	26,118,927.56	0.32
71	605358	立昂微	609,796	25,977,309.60	0.31
72	601699	潞安环能	1,539,800	25,945,630.00	0.31
73	300357	我武生物	468,767	25,829,061.70	0.31
74	601162	天风证券	8,906,500	25,561,655.00	0.31
75	000683	远兴能源	3,259,500	25,554,480.00	0.31
76	601607	上海医药	1,426,400	25,432,712.00	0.31
77	603596	伯特利	316,700	25,272,660.00	0.31
78	688567	孚能科技	934,581	25,261,724.43	0.31
79	002568	百润股份	674,796	25,210,378.56	0.31
80	600392	盛和资源	1,800,170	25,202,380.00	0.31
81	600161	天坛生物	1,058,000	25,106,340.00	0.30

82	000932	华菱钢铁	5,327,741	25,040,382.70	0.30
83	600486	扬农化工	240,414	24,979,014.60	0.30
84	601168	西部矿业	2,448,442	24,974,108.40	0.30
85	600109	国金证券	2,869,000	24,960,300.00	0.30
86	600499	科达制造	1,751,600	24,890,236.00	0.30
87	000831	中国稀土	754,600	24,811,248.00	0.30
88	600521	华海药业	1,132,800	24,763,008.00	0.30
89	600027	华电国际	4,188,400	24,627,792.00	0.30
90	002223	鱼跃医疗	771,460	24,578,715.60	0.30
91	002797	第一创业	4,321,100	24,327,793.00	0.29
92	603077	和邦生物	7,941,048	24,140,785.92	0.29
93	600862	中航高科	1,073,100	23,919,399.00	0.29
94	002078	太阳纸业	2,071,007	23,858,000.64	0.29
95	000999	华润三九	505,271	23,651,735.51	0.29
96	000975	银泰黄金	2,139,122	23,615,906.88	0.29
97	601636	旗滨集团	2,068,300	23,557,937.00	0.29
98	002294	信立泰	715,227	23,495,206.95	0.28
99	688385	复旦微电	335,692	23,434,658.52	0.28
100	601872	招商轮船	4,174,200	23,333,778.00	0.28
101	002268	电科网安	759,555	23,189,214.15	0.28
102	600497	驰宏锌锗	4,576,800	23,158,608.00	0.28
103	600143	金发科技	2,389,700	23,156,193.00	0.28
104	002025	航天电器	348,300	23,074,875.00	0.28
105	002532	天山铝业	2,987,800	23,065,816.00	0.28
106	002299	圣农发展	959,157	22,722,429.33	0.28
107	300253	卫宁健康	2,205,198	22,669,435.44	0.27
108	601696	中银证券	2,140,100	22,620,857.00	0.27
109	600177	雅戈尔	3,566,000	22,572,780.00	0.27
110	601990	南京证券	2,840,045	22,521,556.85	0.27
111	002439	启明星辰	858,900	22,400,112.00	0.27
112	600705	中航产融	6,807,600	22,328,928.00	0.27
113	603737	三棵树	195,630	22,268,562.90	0.27
114	002624	完美世界	1,744,100	22,184,952.00	0.27
115	000591	太阳能	3,010,800	22,069,164.00	0.27
116	600348	华阳股份	1,547,300	22,049,025.00	0.27
117	000998	隆平高科	1,353,097	21,744,268.79	0.26
118	000738	航发控制	842,100	21,591,444.00	0.26
119	002850	科达利	181,600	21,575,896.00	0.26
120	600026	中远海能	1,784,519	21,503,453.95	0.26
121	600258	首旅酒店	864,860	21,448,528.00	0.26
122	600549	厦门钨业	1,092,380	21,356,029.00	0.26
123	000728	国元证券	3,362,700	21,285,891.00	0.26
124	600482	中国动力	1,387,600	21,216,404.00	0.26

125	000988	华工科技	1,292,122	21,203,722.02	0.26
126	688301	奕瑞科技	46,027	21,074,842.76	0.26
127	000519	中兵红箭	1,072,129	21,056,613.56	0.26
128	002273	水晶光电	1,784,490	21,039,137.10	0.25
129	002673	西部证券	3,445,000	20,980,050.00	0.25
130	300604	长川科技	464,000	20,685,120.00	0.25
131	601997	贵阳银行	3,757,900	20,630,871.00	0.25
132	300136	信维通信	1,244,951	20,554,141.01	0.25
133	002507	涪陵榨菜	796,631	20,529,180.87	0.25
134	300832	新产业	403,036	20,208,225.04	0.24
135	002092	中泰化学	2,672,542	19,937,163.32	0.24
136	300363	博腾股份	487,200	19,902,120.00	0.24
137	000703	恒逸石化	2,823,200	19,847,096.00	0.24
138	002430	杭氧股份	503,584	19,821,066.24	0.24
139	600325	华发股份	2,174,177	19,698,043.62	0.24
140	002030	达安基因	1,263,690	19,663,016.40	0.24
141	002739	万达电影	1,399,500	19,593,000.00	0.24
142	002056	横店东磁	1,044,616	19,576,103.84	0.24
143	002557	洽洽食品	389,994	19,499,700.00	0.24
144	300308	中际旭创	719,741	19,454,599.23	0.24
145	600529	山东药玻	682,085	19,371,214.00	0.23
146	601666	平煤股份	1,783,600	19,280,716.00	0.23
147	600704	物产中大	4,006,000	19,268,860.00	0.23
148	002465	海格通信	2,368,900	19,235,468.00	0.23
149	603233	大参林	485,580	19,228,968.00	0.23
150	601198	东兴证券	2,490,300	19,225,116.00	0.23
151	000729	燕京啤酒	1,809,130	19,212,960.60	0.23
152	002156	通富微电	1,164,390	19,189,147.20	0.23
153	601016	节能风电	5,024,685	19,144,049.85	0.23
154	600655	豫园股份	2,503,300	19,050,113.00	0.23
155	600879	航天电子	2,793,984	18,999,091.20	0.23
156	300088	长信科技	3,152,859	18,822,568.23	0.23
157	603658	安图生物	301,900	18,672,515.00	0.23
158	002080	中材科技	864,800	18,532,664.00	0.22
159	600546	山煤国际	1,274,900	18,473,301.00	0.22
160	600415	小商品城	3,522,600	18,458,424.00	0.22
161	002409	雅克科技	366,400	18,455,568.00	0.22
162	002353	杰瑞股份	660,086	18,423,000.26	0.22
163	603267	鸿远电子	181,550	18,365,598.00	0.22
164	000830	鲁西化工	1,477,383	18,304,775.37	0.22
165	000878	云南铜业	1,545,900	18,164,325.00	0.22
166	002683	广东宏大	673,485	18,157,155.60	0.22
167	000960	锡业股份	1,287,593	18,155,061.30	0.22

168	688116	天奈科技	235,268	18,148,573.52	0.22
169	000400	许继电气	908,585	18,144,442.45	0.22
170	600516	方大炭素	2,936,000	17,968,320.00	0.22
171	000623	吉林敖东	1,197,888	17,956,341.12	0.22
172	600170	上海建工	6,863,570	17,845,282.00	0.22
173	603160	汇顶科技	352,900	17,715,580.00	0.21
174	002444	巨星科技	928,384	17,620,728.32	0.21
175	300418	昆仑万维	1,217,342	17,541,898.22	0.21
176	600637	东方明珠	2,633,600	17,513,440.00	0.21
177	002531	天顺风能	1,155,400	17,481,202.00	0.21
178	300017	网宿科技	3,132,600	17,479,908.00	0.21
179	601577	长沙银行	2,585,600	17,478,656.00	0.21
180	002372	伟星新材	816,256	17,418,903.04	0.21
181	600166	福田汽车	6,169,500	17,336,295.00	0.21
182	600739	辽宁成大	1,375,600	17,318,804.00	0.21
183	300373	扬杰科技	329,200	17,315,920.00	0.21
184	600642	申能股份	3,154,000	17,315,460.00	0.21
185	600699	均胜电子	1,232,340	17,314,377.00	0.21
186	601456	国联证券	1,536,300	17,283,375.00	0.21
187	603712	七一二	493,700	17,240,004.00	0.21
188	002326	永太科技	786,800	17,175,844.00	0.21
189	688002	睿创微纳	461,659	17,169,098.21	0.21
190	002203	海亮股份	1,513,894	17,107,002.20	0.21
191	603444	吉比特	54,579	17,074,494.36	0.21
192	000970	中科三环	1,251,232	17,066,804.48	0.21
193	603026	胜华新材	184,594	17,038,026.20	0.21
194	603127	昭衍新药	290,312	16,957,123.92	0.21
195	002508	老板电器	610,700	16,953,032.00	0.21
196	000155	川能动力	949,300	16,935,512.00	0.21
197	600673	东阳光	1,937,794	16,839,429.86	0.20
198	689009	九号公司	551,533	16,816,241.17	0.20
199	600380	健康元	1,484,223	16,756,877.67	0.20
200	000039	中集集团	2,367,202	16,665,102.08	0.20
201	600909	华安证券	3,623,270	16,630,809.30	0.20
202	600056	中国医药	961,907	16,573,657.61	0.20
203	300676	华大基因	319,400	16,509,786.00	0.20
204	600038	中直股份	355,161	16,483,022.01	0.20
205	600867	通化东宝	1,791,700	16,447,806.00	0.20
206	600118	中国卫星	758,488	16,345,416.40	0.20
207	600985	淮北矿业	1,276,400	16,337,920.00	0.20
208	000750	国海证券	4,894,791	16,299,654.03	0.20
209	002065	东华软件	2,879,000	16,295,140.00	0.20
210	000739	普洛药业	756,005	16,284,347.70	0.20

211	300244	迪安诊断	644,911	16,206,613.43	0.20
212	300058	蓝色光标	3,198,582	16,152,839.10	0.20
213	600008	首创环保	5,660,830	16,020,148.90	0.19
214	600369	西南证券	4,271,300	16,017,375.00	0.19
215	688009	中国通号	3,324,175	15,922,798.25	0.19
216	300474	景嘉微	290,920	15,875,504.40	0.19
217	002152	广电运通	1,596,935	15,873,533.90	0.19
218	600372	中航电子	991,480	15,833,935.60	0.19
219	300558	贝达药业	320,600	15,795,962.00	0.19
220	002831	裕同科技	476,157	15,746,511.99	0.19
221	600998	九州通	1,206,100	15,727,544.00	0.19
222	601880	辽港股份	9,674,449	15,672,607.38	0.19
223	000513	丽珠集团	479,735	15,581,792.80	0.19
224	000027	深圳能源	2,444,084	15,544,374.24	0.19
225	600435	北方导航	1,339,810	15,541,796.00	0.19
226	300866	安克创新	262,100	15,534,667.00	0.19
227	002936	郑州银行	6,605,878	15,523,813.30	0.19
228	000547	航天发展	1,649,200	15,485,988.00	0.19
229	000636	风华高科	1,040,277	15,427,307.91	0.19
230	300070	碧水源	3,259,738	15,418,560.74	0.19
231	002408	齐翔腾达	2,189,283	15,412,552.32	0.19
232	002131	利欧股份	8,676,379	15,357,190.83	0.19
233	300026	红日药业	2,702,300	15,349,064.00	0.19
234	002506	协鑫集成	5,259,400	15,304,854.00	0.19
235	002926	华西证券	2,024,000	15,240,720.00	0.18
236	002212	天融信	1,520,268	15,187,477.32	0.18
237	603883	老百姓	375,168	15,183,048.96	0.18
238	600378	昊华科技	351,100	15,065,701.00	0.18
239	300383	光环新网	1,845,519	15,059,435.04	0.18
240	002183	怡亚通	2,336,500	15,023,695.00	0.18
241	300682	朗新科技	681,200	14,972,776.00	0.18
242	603858	步长制药	710,048	14,918,108.48	0.18
243	600820	隧道股份	2,826,220	14,894,179.40	0.18
244	603893	瑞芯微	216,392	14,889,933.52	0.18
245	002572	索菲亚	818,564	14,865,122.24	0.18
246	600271	航天信息	1,427,400	14,859,234.00	0.18
247	002195	二三四五	7,357,478	14,788,530.78	0.18
248	002368	太极股份	523,695	14,731,540.35	0.18
249	300296	利亚德	2,601,700	14,725,622.00	0.18
250	002250	联化科技	949,450	14,716,475.00	0.18
251	600580	卧龙电驱	1,180,219	14,705,528.74	0.18
252	600848	上海临港	1,232,300	14,689,016.00	0.18
253	000887	中鼎股份	1,015,000	14,687,050.00	0.18

254	600390	五矿资本	2,887,200	14,666,976.00	0.18
255	002500	山西证券	2,766,714	14,663,584.20	0.18
256	600863	内蒙华电	4,191,400	14,627,986.00	0.18
257	603156	养元饮品	650,840	14,494,206.80	0.18
258	600021	上海电力	1,446,300	14,477,463.00	0.18
259	688779	长远锂科	991,922	14,472,141.98	0.18
260	002958	青农商行	4,998,300	14,445,087.00	0.17
261	601958	金钼股份	1,245,500	14,385,525.00	0.17
262	688538	和辉光电	5,355,153	14,351,810.04	0.17
263	300024	机器人	1,594,033	14,314,416.34	0.17
264	300001	特锐德	937,326	14,256,728.46	0.17
265	600755	厦门国贸	1,980,511	14,140,848.54	0.17
266	002244	滨江集团	1,599,670	14,125,086.10	0.17
267	300009	安科生物	1,502,778	14,066,002.08	0.17
268	600208	新湖中宝	5,523,300	14,029,182.00	0.17
269	002155	湖南黄金	1,080,217	13,988,810.15	0.17
270	600316	洪都航空	554,672	13,972,187.68	0.17
271	002511	中顺洁柔	1,011,283	13,895,028.42	0.17
272	688521	芯原股份	315,164	13,889,277.48	0.17
273	603885	吉祥航空	855,900	13,848,462.00	0.17
274	688256	寒武纪	253,786	13,846,564.16	0.17
275	600315	上海家化	434,677	13,844,462.45	0.17
276	000997	新大陆	1,059,574	13,785,057.74	0.17
277	000060	中金岭南	3,361,771	13,783,261.10	0.17
278	601231	环旭电子	846,900	13,745,187.00	0.17
279	000050	深天马 A	1,580,784	13,689,589.44	0.17
280	600060	海信视像	1,008,367	13,653,289.18	0.17
281	601992	金隅集团	5,358,500	13,610,590.00	0.16
282	601005	重庆钢铁	8,612,600	13,607,908.00	0.16
283	300850	新强联	255,280	13,601,318.40	0.16
284	300776	帝尔激光	107,700	13,570,200.00	0.16
285	603927	中科软	455,876	13,498,488.36	0.16
286	600511	国药股份	482,609	13,464,791.10	0.16
287	603218	日月股份	659,220	13,382,166.00	0.16
288	601717	郑煤机	1,181,271	13,182,984.36	0.16
289	600528	中铁工业	1,712,410	13,065,688.30	0.16
290	300251	光线传媒	1,504,700	13,030,702.00	0.16
291	600801	华新水泥	877,025	12,997,510.50	0.16
292	600201	生物股份	1,438,361	12,959,632.61	0.16
293	002939	长城证券	1,557,300	12,894,444.00	0.16
294	000021	深科技	1,205,392	12,885,640.48	0.16
295	300168	万达信息	1,523,427	12,842,489.61	0.16
296	600566	济川药业	471,800	12,842,396.00	0.16



297	600066	宇通客车	1,706,600	12,816,566.00	0.16
298	600171	上海贝岭	731,276	12,746,140.68	0.15
299	000825	太钢不锈	2,948,072	12,735,671.04	0.15
300	688185	康希诺	87,210	12,734,404.20	0.15
301	002373	千方科技	1,420,272	12,668,826.24	0.15
302	600906	财达证券	1,668,300	12,629,031.00	0.15
303	600598	北大荒	915,200	12,593,152.00	0.15
304	600839	四川长虹	4,745,200	12,527,328.00	0.15
305	300677	英科医疗	594,540	12,503,176.20	0.15
306	600827	百联股份	1,030,563	12,490,423.56	0.15
307	600282	南钢股份	3,961,500	12,478,725.00	0.15
308	600535	天士力	1,154,100	12,418,116.00	0.15
309	600970	中材国际	1,454,077	12,388,736.04	0.15
310	601866	中远海发	5,093,500	12,326,270.00	0.15
311	601665	齐鲁银行	2,944,600	12,278,982.00	0.15
312	601778	晶科科技	2,226,500	12,245,750.00	0.15
313	300861	美畅股份	248,100	12,196,596.00	0.15
314	002128	电投能源	988,107	12,193,240.38	0.15
315	600500	中化国际	1,844,610	12,192,872.10	0.15
316	601179	中国西电	2,635,700	12,150,577.00	0.15
317	002127	南极电商	2,521,200	12,126,972.00	0.15
318	603568	伟明环保	653,467	12,108,743.51	0.15
319	002153	石基信息	806,680	12,092,133.20	0.15
320	600498	烽火通信	916,300	12,040,182.00	0.15
321	688188	柏楚电子	55,441	12,035,132.28	0.15
322	000930	中粮科技	1,436,827	12,011,873.72	0.15
323	000709	河钢股份	5,311,400	12,003,764.00	0.15
324	603000	人民网	709,800	11,974,326.00	0.15
325	002595	豪迈科技	516,385	11,954,312.75	0.14
326	300888	稳健医疗	167,000	11,940,500.00	0.14
327	300182	捷成股份	2,647,900	11,836,113.00	0.14
328	000012	南玻 A	1,763,092	11,830,347.32	0.14
329	600398	海澜之家	2,221,400	11,773,420.00	0.14
330	002701	奥瑞金	2,315,445	11,692,997.25	0.14
331	000987	越秀资本	1,935,515	11,593,734.85	0.14
332	002019	亿帆医药	946,260	11,591,685.00	0.14
333	002985	北摩高科	256,935	11,587,768.50	0.14
334	002124	天邦食品	1,892,718	11,564,506.98	0.14
335	002396	星网锐捷	600,329	11,502,303.64	0.14
336	600959	江苏有线	3,853,470	11,444,805.90	0.14
337	000581	威孚高科	645,190	11,439,218.70	0.14
338	600895	张江高科	995,362	11,287,405.08	0.14
339	000598	兴蓉环境	2,302,700	11,260,203.00	0.14

340	603707	健友股份	624,159	11,259,828.36	0.14
341	000401	冀东水泥	1,365,700	11,239,711.00	0.14
342	000778	新兴铸管	3,075,775	11,226,578.75	0.14
343	300618	寒锐钴业	279,440	11,191,572.00	0.14
344	300115	长盈精密	1,079,266	11,148,817.78	0.14
345	688208	道通科技	353,136	11,141,440.80	0.13
346	600582	天地科技	2,125,700	11,053,640.00	0.13
347	002670	国盛金控	1,489,888	11,040,070.08	0.13
348	600663	陆家嘴	1,129,093	10,997,365.82	0.13
349	002249	大洋电机	2,136,784	10,940,334.08	0.13
350	600297	广汇汽车	5,209,300	10,939,530.00	0.13
351	600718	东软集团	1,099,100	10,936,045.00	0.13
352	300482	万孚生物	342,638	10,919,873.06	0.13
353	600507	方大特钢	1,796,173	10,812,961.46	0.13
354	002690	美亚光电	451,818	10,798,450.20	0.13
355	002266	浙富控股	2,757,615	10,782,274.65	0.13
356	600329	达仁堂	367,909	10,706,151.90	0.13
357	603225	新凤鸣	983,216	10,697,390.08	0.13
358	600517	国网英大	2,201,800	10,656,712.00	0.13
359	000883	湖北能源	2,529,800	10,625,160.00	0.13
360	688690	纳微科技	204,223	10,572,624.71	0.13
361	002505	鹏都农牧	4,094,830	10,564,661.40	0.13
362	603866	桃李面包	685,005	10,549,077.00	0.13
363	600409	三友化工	1,593,056	10,530,100.16	0.13
364	300212	易华录	515,759	10,526,641.19	0.13
365	000656	金科股份	5,487,900	10,481,889.00	0.13
366	600259	广晟有色	260,611	10,476,562.20	0.13
367	601000	唐山港	3,805,966	10,428,346.84	0.13
368	600022	山东钢铁	7,034,020	10,410,349.60	0.13
369	002002	鸿达兴业	3,205,172	10,384,757.28	0.13
370	000089	深圳机场	1,317,391	10,354,693.26	0.13
371	600871	石化油服	5,228,500	10,352,430.00	0.13
372	601106	中国一重	3,522,700	10,321,511.00	0.13
373	600064	南京高科	1,558,378	10,300,878.58	0.12
374	600567	山鹰国际	4,150,700	10,293,736.00	0.12
375	000785	居然之家	2,513,300	10,279,397.00	0.12
376	300376	易事特	1,490,000	10,176,700.00	0.12
377	600216	浙江医药	870,300	10,173,807.00	0.12
378	002468	申通快递	983,400	10,158,522.00	0.12
379	002429	兆驰股份	2,910,543	10,157,795.07	0.12
380	600782	新钢股份	2,457,100	10,049,539.00	0.12
381	002081	金螳螂	2,046,893	9,927,431.05	0.12
382	601333	广深铁路	4,358,400	9,893,568.00	0.12

383	601718	际华集团	3,385,900	9,852,969.00	0.12
384	600667	太极实业	1,896,500	9,785,940.00	0.12
385	688029	南微医学	118,560	9,737,332.80	0.12
386	601187	厦门银行	1,695,500	9,715,215.00	0.12
387	600062	华润双鹤	538,246	9,629,220.94	0.12
388	601118	海南橡胶	2,197,100	9,623,298.00	0.12
389	002010	传化智联	1,799,000	9,606,660.00	0.12
390	002191	劲嘉股份	1,323,519	9,569,042.37	0.12
391	300463	迈克生物	552,814	9,563,682.20	0.12
392	600597	光明乳业	887,623	9,550,823.48	0.12
393	600728	佳都科技	1,806,500	9,538,320.00	0.12
394	600737	中粮糖业	1,373,786	9,534,074.84	0.12
395	000540	中天金融	6,301,925	9,515,906.75	0.12
396	000537	广宇发展	717,300	9,489,879.00	0.11
397	600155	华创阳安	1,451,400	9,434,100.00	0.11
398	600376	首开股份	1,657,869	9,433,274.61	0.11
399	601156	东航物流	613,000	9,354,380.00	0.11
400	002221	东华能源	1,217,255	9,287,655.65	0.11
401	002745	木林森	1,142,336	9,264,344.96	0.11
402	600131	国网信通	619,100	9,261,736.00	0.11
403	601098	中南传媒	924,500	9,226,510.00	0.11
404	300072	海新能科	2,112,281	9,209,545.16	0.11
405	002416	爱施德	956,341	9,066,112.68	0.11
406	600967	内蒙一机	1,093,694	9,033,912.44	0.11
407	600126	杭钢股份	2,167,740	8,952,766.20	0.11
408	603379	三美股份	314,176	8,941,448.96	0.11
409	000156	华数传媒	1,187,900	8,897,371.00	0.11
410	601991	大唐发电	3,183,600	8,882,244.00	0.11
411	603228	景旺电子	433,980	8,783,755.20	0.11
412	002048	宁波华翔	628,405	8,734,829.50	0.11
413	600808	马钢股份	3,105,000	8,725,050.00	0.11
414	601568	北元集团	1,532,400	8,688,708.00	0.11
415	000937	冀中能源	1,362,000	8,662,320.00	0.10
416	002281	光迅科技	540,823	8,501,737.56	0.10
417	002423	中粮资本	1,181,800	8,461,688.00	0.10
418	600901	江苏租赁	1,537,400	8,424,952.00	0.10
419	001914	招商积余	546,934	8,411,844.92	0.10
420	688289	圣湘生物	382,220	8,389,729.00	0.10
421	600373	中文传媒	872,700	8,351,739.00	0.10
422	600095	湘财股份	1,099,300	8,310,708.00	0.10
423	300630	普利制药	336,322	8,293,700.52	0.10
424	003035	南网能源	1,458,600	8,270,262.00	0.10
425	000559	万向钱潮	1,697,961	8,269,070.07	0.10

426	603056	德邦股份	394,967	8,227,162.61	0.10
427	000898	鞍钢股份	3,080,100	8,223,867.00	0.10
428	002434	万里扬	1,011,342	8,141,303.10	0.10
429	603317	天味食品	294,128	8,082,637.44	0.10
430	000402	金融街	1,538,600	8,077,650.00	0.10
431	301029	怡合达	121,900	8,013,706.00	0.10
432	002867	周大生	564,598	7,921,309.94	0.10
433	600556	天下秀	1,159,295	7,813,648.30	0.09
434	601608	中信重工	2,232,443	7,791,226.07	0.09
435	601598	中国外运	2,026,200	7,780,608.00	0.09
436	601928	凤凰传媒	981,600	7,774,272.00	0.09
437	601611	中国核建	1,020,700	7,757,320.00	0.09
438	000563	陕国投 A	2,545,179	7,711,892.37	0.09
439	300257	开山股份	511,948	7,679,220.00	0.09
440	600195	中牧股份	656,382	7,627,158.84	0.09
441	600707	彩虹股份	1,842,100	7,626,294.00	0.09
442	002948	青岛银行	2,268,440	7,621,958.40	0.09
443	000959	首钢股份	2,009,947	7,577,500.19	0.09
444	001203	大中矿业	582,700	7,534,311.00	0.09
445	600968	海油发展	2,613,800	7,527,744.00	0.09
446	000967	盈峰环境	1,634,145	7,419,018.30	0.09
447	600167	联美控股	1,173,650	7,417,468.00	0.09
448	002110	三钢闽光	1,575,859	7,406,537.30	0.09
449	603650	彤程新材	231,426	7,134,863.58	0.09
450	002705	新宝股份	423,465	7,050,692.25	0.09
451	000415	渤海租赁	3,176,043	7,019,055.03	0.09
452	000990	诚志股份	778,800	6,853,440.00	0.08
453	300869	康泰医学	208,300	6,784,331.00	0.08
454	688006	杭可科技	153,912	6,736,728.24	0.08
455	600307	酒钢宏兴	4,024,700	6,640,755.00	0.08
456	002925	盈趣科技	401,379	6,630,781.08	0.08
457	601828	美凯龙	1,392,296	6,529,868.24	0.08
458	002242	九阳股份	393,418	6,483,528.64	0.08
459	603638	艾迪精密	430,360	6,420,971.20	0.08
460	600339	中油工程	2,150,400	6,408,192.00	0.08
461	688819	天能股份	172,343	6,331,881.82	0.08
462	600764	中国海防	274,901	6,311,726.96	0.08
463	000031	大悦城	1,652,983	6,215,216.08	0.08
464	002399	海普瑞	478,558	6,149,470.30	0.07
465	600623	华谊集团	971,300	6,138,616.00	0.07
466	002146	荣盛发展	2,792,300	6,059,291.00	0.07
467	600928	西安银行	1,712,900	6,029,408.00	0.07
468	002653	海思科	264,990	5,896,027.50	0.07

469	603719	良品铺子	157,269	5,798,508.03	0.07
470	688088	虹软科技	257,070	5,786,645.70	0.07
471	601969	海南矿业	776,700	5,755,347.00	0.07
472	600006	东风汽车	1,027,732	5,734,744.56	0.07
473	600648	外高桥	478,400	5,716,880.00	0.07
474	600787	中储股份	1,122,970	5,581,160.90	0.07
475	002563	森马服饰	1,038,200	5,440,168.00	0.07
476	000961	中南建设	2,457,100	5,381,049.00	0.07
477	000869	张裕 A	177,262	5,360,402.88	0.06
478	600377	宁沪高速	638,000	5,244,360.00	0.06
479	601869	长飞光纤	159,283	5,197,404.29	0.06
480	000553	安道麦 A	560,800	5,075,240.00	0.06
481	601298	青岛港	902,400	5,062,464.00	0.06
482	600350	山东高速	870,600	4,953,714.00	0.06
483	000062	深圳华强	402,121	4,909,897.41	0.06
484	601139	深圳燃气	738,400	4,829,136.00	0.06
485	002945	华林证券	346,600	4,568,188.00	0.06
486	600299	安迪苏	519,300	4,289,418.00	0.05
487	001872	招商港口	298,642	4,288,499.12	0.05
488	601228	广州港	1,357,100	4,274,865.00	0.05
489	603355	莱克电气	150,398	4,217,159.92	0.05
490	603868	飞科电器	60,605	4,080,534.65	0.05
491	601158	重庆水务	739,200	3,792,096.00	0.05
492	300741	华宝股份	160,800	3,783,624.00	0.05
493	600956	新天绿能	391,400	3,773,096.00	0.05
494	603786	科博达	51,100	3,363,913.00	0.04
495	600927	永安期货	207,700	3,348,124.00	0.04
496	600917	重庆燃气	402,800	3,206,288.00	0.04
497	600032	浙江新能	268,400	3,083,916.00	0.04
498	001227	兰州银行	803,200	3,028,064.00	0.04
499	688772	珠海冠宇	142,067	2,648,128.88	0.03
500	002901	大博医疗	73,900	2,514,817.00	0.03

### 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

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	301269	华大九天	1,168	102,713.92	0.00
2	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.00
3	301267	华夏眼科	1,006	66,597.20	0.00
4	301095	广立微	740	64,002.60	0.00
5	301308	江波龙	819	46,453.68	0.00
6	301327	华宝新能	242	42,826.74	0.00
7	301239	普瑞眼科	575	40,066.00	0.00
8	301367	怡和嘉业	223	39,198.94	0.00

9	301175	中科环保	6,370	38,283.70	0.00
10	301165	锐捷网络	1,077	34,043.97	0.00
11	301301	川宁生物	3,574	26,912.22	0.00
12	301356	天振股份	614	26,604.62	0.00
13	301195	北路智控	330	24,103.20	0.00
14	301389	隆扬电子	1,269	21,776.04	0.00
15	301330	熵基科技	694	21,729.14	0.00
16	301152	天力锂能	433	20,195.12	0.00
17	301391	卡莱特	247	19,999.59	0.00
18	301349	信德新材	180	18,633.60	0.00
19	301171	易点天下	985	17,454.20	0.00
20	301363	美好医疗	445	16,843.25	0.00
21	301115	建科股份	685	16,467.40	0.00
22	301296	新巨丰	1,042	15,525.80	0.00
23	301223	中荣股份	815	14,775.95	0.00
24	301328	维峰电子	191	14,699.36	0.00
25	301121	紫建电子	290	14,433.30	0.00
26	301139	元道通信	566	14,325.46	0.00
27	301339	通行宝	913	14,233.67	0.00
28	301335	天元宠物	420	14,204.40	0.00
29	301377	鼎泰高科	770	13,575.10	0.00
30	301311	昆船智能	832	13,195.52	0.00
31	301230	泓博医药	269	12,998.08	0.00
32	301338	凯格精机	257	12,590.43	0.00
33	301365	矩阵股份	516	12,316.92	0.00
34	301366	一博科技	268	12,084.12	0.00
35	301290	东星医疗	330	11,592.90	0.00
36	301132	满坤科技	468	11,456.64	0.00
37	301379	天山电子	449	11,058.87	0.00
38	301282	金禄电子	434	10,958.50	0.00
39	301361	众智科技	517	10,836.32	0.00
40	301306	西测测试	255	10,783.95	0.00
41	301273	瑞晨环保	277	10,467.83	0.00
42	301265	华新环保	819	9,336.60	0.00
43	301176	逸豪新材	544	9,188.16	0.00
44	301318	维海德	206	8,598.44	0.00
45	301227	森鹰窗业	284	8,375.16	0.00
46	301326	捷邦科技	227	8,312.74	0.00
47	301161	唯万密封	346	7,518.58	0.00
48	301398	星源卓镁	255	7,379.70	0.00
49	301313	凡拓数创	247	7,197.58	0.00
50	301285	鸿日达	565	7,119.00	0.00
51	301276	嘉曼服饰	303	6,850.83	0.00

52	301388	欣灵电气	292	6,307.20	0.00
53	301368	丰立智能	337	6,241.24	0.00
54	301300	远翔新材	211	6,197.07	0.00
55	301319	唯特偶	115	6,126.05	0.00
56	301231	荣信文化	275	5,604.50	0.00
57	301309	万得凯	228	5,576.88	0.00
58	301233	盛帮股份	158	5,419.40	0.00
59	301316	慧博云通	359	5,140.88	0.00

#### 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	688122	西部超导	82,475,947.45	2.23
2	600522	中天科技	72,433,427.68	1.96
3	600563	法拉电子	68,810,882.46	1.86
4	688777	中控技术	67,001,101.31	1.82
5	600256	广汇能源	64,528,799.04	1.75
6	603345	安井食品	61,248,479.56	1.66
7	603605	珀莱雅	56,743,158.62	1.54
8	600096	云天化	55,089,881.87	1.49
9	600157	永泰能源	51,906,615.00	1.41
10	601615	明阳智能	51,727,147.88	1.40
11	300769	德方纳米	48,414,682.66	1.31
12	603613	国联股份	47,070,852.18	1.28
13	002340	格林美	46,792,116.90	1.27
14	603267	鸿远电子	46,255,056.10	1.25
15	600487	亨通光电	46,071,819.18	1.25
16	688099	晶晨股份	44,898,839.89	1.22
17	601058	赛轮轮胎	43,877,185.64	1.19
18	688180	君实生物	43,388,273.87	1.18
19	689009	九号公司	43,296,996.82	1.17
20	600765	中航重机	42,727,314.07	1.16

##### 8.4.2 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	600522	中天科技	97,944,906.86	2.65
2	600256	广汇能源	94,369,492.19	2.56
3	601615	明阳智能	85,068,936.70	2.30
4	600563	法拉电子	66,570,802.45	1.80
5	600233	圆通速递	58,316,139.74	1.58

6	600732	爱旭股份	55,820,307.96	1.51
7	688122	西部超导	50,949,547.22	1.38
8	603605	珀莱雅	47,933,667.23	1.30
9	002180	纳思达	46,652,733.00	1.26
10	600875	东方电气	45,368,502.59	1.23
11	603267	鸿远电子	45,142,398.80	1.22
12	688180	君实生物	44,598,043.43	1.21
13	600039	四川路桥	41,832,037.62	1.13
14	300769	德方纳米	41,167,813.29	1.12
15	688005	容百科技	40,668,364.87	1.10
16	688777	中控技术	38,573,003.47	1.05
17	688099	晶晨股份	37,437,505.86	1.01
18	600157	永泰能源	37,238,722.00	1.01
19	600486	扬农化工	36,723,813.64	0.99
20	605117	德业股份	36,142,501.81	0.98

#### 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	7,015,121,048.34
卖出股票收入（成交）总额	5,266,971,960.10

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.2 项“卖出金额”及 8.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

#### 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

无。

#### 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

无。

#### 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

无。

#### 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

无。

#### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货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。



## 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

无。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

## 8.12 投资组合报告附注

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

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

### 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	10,487,737.62
2	应收清算款	-
3	应收股利	154,000.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	237,412.12
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,879,149.74

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002340	格林美	5,557,640.00	0.07	转融通出借证券
2	300012	华测检测	5,461,270.00	0.07	转融通出借证券
3	600157	永泰能源	4,957,812.00	0.06	转融通出借证券
4	002384	东山精密	4,928,689.00	0.06	转融通出借证券

5	300724	捷佳伟创	4,640,614.00	0.06	转融通出借证券
6	688777	中控技术	4,605,081.00	0.06	转融通出借证券
7	603613	国联股份	4,501,596.00	0.05	转融通出借证券
8	688122	西部超导	4,478,837.00	0.05	转融通出借证券
9	300003	乐普医疗	4,410,240.00	0.05	转融通出借证券
10	002422	科伦药业	4,395,972.00	0.05	转融通出借证券

### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	301269	华大九天	102,713.92	0.00	新股锁定
2	301267	华夏眼科	66,597.20	0.00	新股锁定
3	301095	广立微	64,002.60	0.00	新股锁定
4	301308	江波龙	46,453.68	0.00	新股锁定

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## §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

#### 9.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
15,409	89,445.77	1,305,505,030.00	94.72	72,764,901.00	5.28

#### 9.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
嘉实中证 500 交易型开放式 指数证券投资基金联接基金	355,502,628.00	25.79

### 9.2 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	国泰君安证券股份有 限公司	136,815,302.00	9.93
2	中信中证资本管理有 限公司	100,039,249.00	7.26
3	招商证券股份有限公	84,189,451.00	6.11

	司		
4	中信证券股份有限公司	82,201,684.00	5.96
5	申万宏源证券有限公司	81,634,856.00	5.92
6	中国银河证券股份有限公司	77,948,300.00	5.66
7	华泰证券股份有限公司	46,883,241.00	3.40
8	光大证券股份有限公司	37,058,581.00	2.69
9	海通证券股份有限公司	31,665,910.00	2.30
10	东兴证券股份有限公司	30,800,000.00	2.23
11	嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	355,502,628.00	25.79

注：上述基金持有人份额均为场内基金份额。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	970.00	0.00

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

### 9.5 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情况

无。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013年2月6日）基金份额总额	3,108,729,402.00
本报告期期初基金份额总额	449,131,868.00
本报告期基金总申购份额	1,756,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	879,200,000.00
本报告期基金拆分变动份额	52,338,063.00
本报告期期末基金份额总额	1,378,269,931.00

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

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

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

2022 年 5 月 12 日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，龚康先生因工作分工不再担任公司副总经理职务，转任嘉实资本管理有限公司总经理。

(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，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。报告年度应支付普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的审计费 98,000.00 元，该审计机构已连续 10 年为本基金提供审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2022 年 6 月 2 日
采取稽查或处罚等措施的机构	北京证监局
受到的具体措施类型	责令改正
受到稽查或处罚等措施的原因	对子公司管控不严格
管理人采取整改措施的情况(如提出整改意见)	已完成整改并通过北京证监局验收
其他	-
措施 2	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	高级管理人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2022 年 6 月 14 日
采取稽查或处罚等措施的机构	北京证监局
受到的具体措施类型	警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	对子公司管控不严格

管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	-
其他	-
<b>措施 3</b>	<b>内容</b>
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2022 年 12 月 26 日
采取稽查或处罚等措施的机构	北京证监局
受到的具体措施类型	责令改正
受到稽查或处罚等措施的原因	内控管理不完善
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已完成整改并通过北京证监局验收
其他	-

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 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 (%)	
中信建投证券股份有限公司	6	7,493,374,827.60	61.19	840,368.20	20.98	-
长江证券股份有限公司	1	1,739,063,206.18	14.20	1,098,481.53	27.42	-
招商证券股份有限公司	1	1,732,625,163.37	14.15	1,212,854.69	30.28	-
海通证券股份有限公司	1	544,245,333.24	4.44	380,974.80	9.51	-
广发证券股份有限公司	3	409,949,827.63	3.35	258,844.16	6.46	-
开源证券股份有限公司	2	117,766,822.54	0.96	74,357.39	1.86	-
申万宏源证券有限	2	110,243,537.06	0.90	77,171.36	1.93	-

公司						
华西证券股份有限公司	2	98,940,410.20	0.81	62,462.87	1.56	-
安信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
财信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
高盛高华证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国元证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

注：1. 本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

## 2. 交易单元的选择标准和程序

- (1) 经营行为规范；
- (2) 财务状况良好；
- (3) 研究能力较强；

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商

签订协议，并通知基金托管人。

3. 北京高华证券有限责任公司更名为高盛高华证券有限责任公司。

4. 报告期内，本基金新增以下交易单元：国盛证券有限责任公司新增交易单元 2 个，安信证券股份有限公司新增交易单元 2 个，中信建投证券股份有限公司新增交易单元 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	
	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(%)
中信建投证券股份有限公司	2,313,510.95	13.38	276,000,000.00	4.71	-	-
长江证券股份有限公司	2,076,227.12	12.00	3,569,000,000.00	60.97	-	-
招商证券股份有限公司	387,587.42	2.24	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	2,726,128.57	15.76	857,000,000.00	14.64	-	-
开源证券股份有限公司	267,166.81	1.54	428,000,000.00	7.31	-	-
申万宏源证券有限公司	9,116,914.05	52.71	511,000,000.00	8.73	-	-
华西证券股份有限公司	407,582.80	2.36	213,000,000.00	3.64	-	-

司						
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
财信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
高盛高华证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国元证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

### 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	关于嘉实中证 500 交易型开放式指数	上海证券报、基金管理	2022 年 2 月 14 日



	证券投资基金实施基金份额拆分业务的公告	人网站及中国证监会基金电子披露网站	
2	关于嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金份额拆分结果及恢复申购、赎回的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 2 月 18 日
3	关于嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 3 月 25 日
4	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 5 月 12 日
5	嘉实基金管理有限公司关于旗下部分基金投资范围增加存托凭证并相应修订基金合同及托管协议的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 6 月 23 日
6	关于嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 7 月 11 日
7	关于嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 8 月 25 日
8	关于嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 9 月 5 日
9	关于嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金变更场内简称的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 9 月 17 日
10	嘉实基金管理有限公司住所变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 11 月 10 日
11	嘉实基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善客户身份信息的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 12 月 21 日

## § 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

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	2022-01-01 至 2022-12-31	265,970,831.00	774,480,520.00	684,948,723.00	355,502,628.00	25.79
产品特有风险							

报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。

未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金连续 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 5000 万元，还可能面临转换运作方式或者与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会核准嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- (2) 《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实中证 500 交易型开放式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) 报告期内嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金公告的各项原稿。

### 13.2 存放地点

- 1) 北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司
- 2) 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼中国建设银行投资托管业务部

### 13.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.jsfund.cn>

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-600-8800，或发 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2023 年 3 月 30 日