

嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资  
基金  
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 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 8 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经由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 08 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现</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	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	11
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>66</b>
7.1 期末基金资产组合情况	66
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	66
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	68
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	81
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	83

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	83
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	83
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	83
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	83
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	83
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	83
7.12 投资组合报告附注 .....	83
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>85</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	85
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	85
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	86
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	86
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>86</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>86</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	86
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	86
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	87
10.4 基金投资策略的改变 .....	87
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	87
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	87
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	87
10.8 其他重大事件 .....	91
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>92</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	92
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>92</b>
12.1 备查文件目录 .....	92
12.2 存放地点 .....	92
12.3 查阅方式 .....	92

## § 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	1,033,069,931.00 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	100020	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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金中期报告备置地点	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
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	213,022,021.46
本期利润	526,546,237.87
加权平均基金份额本期利润	0.6132
本期加权平均净值利润率	9.69%
本期基金份额净值增长率	3.72%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	3,120,243,107.47
期末可供分配基金份额利润	3.0204
期末基金资产净值	6,417,732,231.67
期末基金份额净值	6.2123
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	94.63%

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。

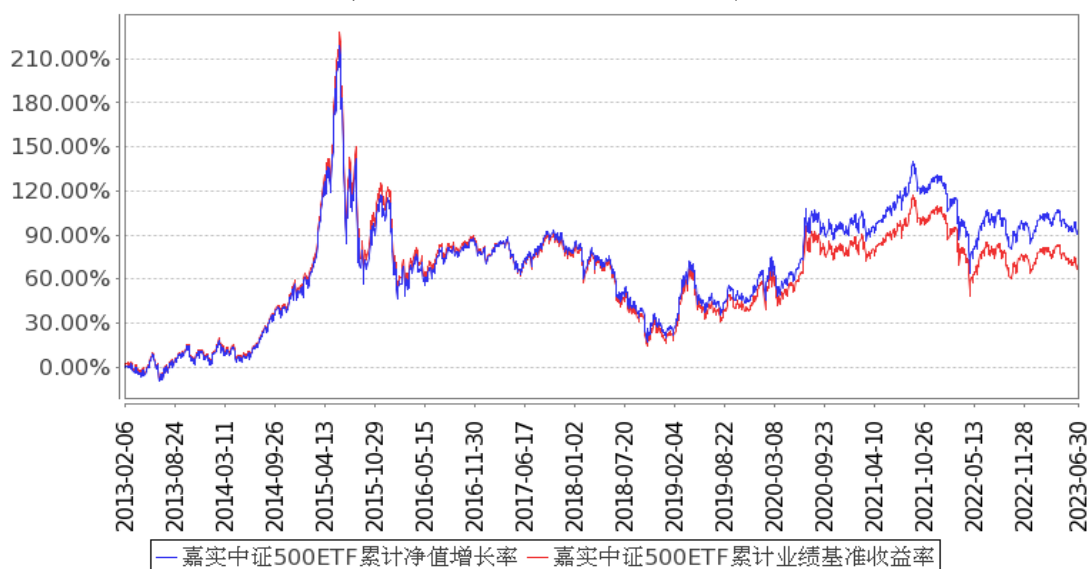
## 3.2 基金净值表现

### 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
过去一个月	-0.02%	0.94%	-0.81%	0.93%	0.79%	0.01%
过去三个月	-4.08%	0.83%	-5.38%	0.83%	1.30%	0.00%
过去六个月	3.72%	0.79%	2.29%	0.79%	1.43%	0.00%
过去一年	-5.00%	0.96%	-7.06%	0.96%	2.06%	0.00%
过去三年	10.40%	1.18%	2.29%	1.19%	8.11%	-0.01%
自基金合同生效起至今	94.63%	1.57%	70.39%	1.58%	24.24%	-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2023年06月30日)



注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起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。

## 3.3 其他指标

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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 2023 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 314 只公募基金，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、基础设施基金等不同类别。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	-	17 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、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实基本面	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。



	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、嘉实中证光伏产业指数发起式基金经理				
--	---	--	--	--	--

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 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，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；通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

### 4.3.2 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 6 次，均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

本基金跟踪中证小盘 500 指数，中证 500 指数由全部 A 股中剔除沪深 300 指数成份股及总市值排名前 300 名的股票后，总市值排名靠前的 500 只股票组成，综合反映中国 A 股市场中一批中小市值公司的股票价格表现。本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。

上半年，在高通胀、美联储持续加息及地缘政治风险的共同作用下，全球经济波动加剧。全球主要经济体步入去库周期，制造业 PMI 进入下行趋势，多个指标表明全球经济依然存在衰退风险。但受益于服务业的持续高景气，全球经济下行势头趋缓。国内方面，上半年，我国经济总体呈现恢复性向好态势，一季度政策前置发力下，国内经济实现良好开局，一季度 GDP 同比增长 4.5%，二季度在海外风险加大、外需减弱和内需增长动力不足等影响下，国内经济增长边际放缓，但在去年低基数效应下，二季度 GDP 同比增长 6.3%，上半年同比增长 5.5%，总体保持持续向好态势。

本报告期内，本基金日均跟踪误差为 0.03%，年化跟踪误差为 0.45%，符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过 0.2%的限制。

### 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 6.2123 元；本报告期基金份额净值增长率为 3.72%，业绩比较基准收益率为 2.29%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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。

#### 4.7 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“6.4.11 利润分配情况”。

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

无。

## § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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，本基金利润分配符合法律法规和基金合同的相关约定。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核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 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 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：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	73,745,343.85	89,776,778.49
结算备付金		28,162,076.80	20,358,179.62
存出保证金		9,804,486.74	10,487,737.62
交易性金融资产	6.4.7.2	6,336,316,048.41	8,174,750,196.18
其中：股票投资		6,336,316,048.41	8,174,750,196.18
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		271,355.27	-
应收股利		2,958,198.07	154,000.00
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	309,104.73	237,412.12
资产总计		6,451,566,613.87	8,295,764,304.03
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		30,741,463.92	36,152,652.95
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		726,779.55	989,578.38
应付托管费		242,259.88	329,859.47
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		23,886.71	23,793.66
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	2,099,992.14	2,825,189.28
负债合计		33,834,382.20	40,321,073.74
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	3,297,489,124.20	4,399,344,102.25
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	3,120,243,107.47	3,856,099,128.04
净资产合计		6,417,732,231.67	8,255,443,230.29
负债和净资产总计		6,451,566,613.87	8,295,764,304.03

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 6.2123 元，基金份额总额 1,033,069,931.00 份。

## 6.2 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		533,035,212.04	-376,563,961.41
1. 利息收入		8,078,826.72	5,300,125.98
其中：存款利息收入	6.4.7.13	394,173.41	248,575.74
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		6,683.56	274,953.36
证券出借利息收入		7,677,969.75	4,776,596.88
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		203,219,081.70	-235,564,225.90
其中：股票投资收益	6.4.7.14	144,195,000.45	-262,959,304.64
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	791,265.31	396,539.82
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-

贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-1,290,795.97	-6,638,954.67
股利收益	6.4.7.19	59,523,611.91	33,637,493.59
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	313,524,216.41	-149,269,503.03
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	8,213,087.21	2,969,641.54
<b>减：二、营业总支出</b>		6,488,974.17	3,660,949.37
1. 管理人报酬		4,134,812.88	2,307,528.74
2. 托管费		1,378,270.99	769,176.23
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		38,826.78	17,201.38
8. 其他费用	6.4.7.23	937,063.52	567,043.02
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		526,546,237.87	-380,224,910.78
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		526,546,237.87	-380,224,910.78
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		526,546,237.87	-380,224,910.78

### 6.3 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	4,399,344,102.25	-	3,856,099,128.04	8,255,443,230.29

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)	4,399,344,102.25	-	3,856,099,128.04	8,255,443,230.29
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-1,101,854,978.05	-	-735,856,020.57	-1,837,710,998.62
(一)、综合收益总额	-	-	526,546,237.87	526,546,237.87
(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)	-1,101,854,978.05	-	-1,262,402,258.44	-2,364,257,236.49
其中:1.基金申购款	3,069,361,954.29	-	2,950,286,674.98	6,019,648,629.27
2.基金赎回款	-4,171,216,932.34	-	-4,212,688,933.42	-8,383,905,865.76
(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)	3,297,489,124.20	-	3,120,243,107.47	6,417,732,231.67
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(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)	-3,752,362.27	-	-413,268,733.64	-417,021,095.91
(一)、综合收益总额	-	-	-380,224,910.78	-380,224,910.78
(二)、本期基金份额交易产	-3,752,362.27	-	-33,043,822.86	-36,796,185.13



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	1,410,042,327.09	-	1,311,463,608.41	2,721,505,935.50
2. 基金赎回款	-1,413,794,689.36	-	-1,344,507,431.27	-2,758,302,120.63
(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)	1,598,104,448.93	-	1,675,782,313.45	3,273,886,762.38

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《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 6.4.4 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。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金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。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
活期存款	73,745,343.85
等于：本金	73,738,969.17
加：应计利息	6,374.68
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	73,745,343.85

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	6,397,058,515.28	-	6,336,316,048.41	-60,742,466.87
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	6,397,058,515.28	-	6,336,316,048.41	-60,742,466.87

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

## 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生 工具	-	-	-	
货币衍生 工具	-	-	-	
权益衍生 工具	72,311,240.00	-	-	
其中：股指期 货投资	72,311,240.00	-	-	
其他衍生 工具	-	-	-	
合计	72,311,240.00	-	-	

## 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2307	IC2307	60.00	71,889,600.00	-421,640.00
合计				-421,640.00
减：可抵销期货 暂收款				-421,640.00
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。

## 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

## 6.4.7.4 买入返售金融资产

## 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

## 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。
----

## 6.4.7.5 债权投资

## 6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

## 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

## 6.4.7.6 其他债权投资

## 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

## 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

## 6.4.7.7 其他权益工具投资

## 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应收利息	-
其他应收款	309,104.73
待摊费用	-
合计	309,104.73

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,633,267.62
其中：交易所市场	1,633,267.62
银行间市场	-

应付利息	-
预提费用	108,104.06
应付指数使用费	358,620.46
合计	2,099,992.14

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,378,269,931.00	4,399,344,102.25
本期申购	961,600,000.00	3,069,361,954.29
本期赎回（以“-”号填列）	-1,306,800,000.00	-4,171,216,932.34
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,033,069,931.00	3,297,489,124.20

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,001,358,737.54	-2,145,259,609.50	3,856,099,128.04
本期利润	213,022,021.46	313,524,216.41	526,546,237.87
本期基金份额交易产生的变动数	-1,447,744,996.68	185,342,738.24	-1,262,402,258.44
其中：基金申购款	4,386,496,727.51	-1,436,210,052.53	2,950,286,674.98
基金赎回款	-5,834,241,724.19	1,621,552,790.77	-4,212,688,933.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,766,635,762.32	-1,646,392,654.85	3,120,243,107.47

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
	活期存款利息收入
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	275,354.70
其他	8,645.61
合计	394,173.41

## 6.4.7.14 股票投资收益

## 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	22,695,680.62
股票投资收益——赎回差价收入	121,499,319.83
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	144,195,000.45

## 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	5,837,878,844.60
减：卖出股票成本总额	5,805,773,421.40
减：交易费用	9,409,742.58
买卖股票差价收入	22,695,680.62

## 6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
赎回基金份额对价总额	8,383,905,865.76
减：现金支付赎回款总额	4,325,707,265.76
减：赎回股票成本总额	3,936,699,280.17
减：交易费用	-
赎回差价收入	121,499,319.83

## 6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

## 6.4.7.15 债券投资收益

## 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	561.37
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券	790,703.94



到期兑付) 差价收入	
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	791, 265. 31

#### 6. 4. 7. 15. 2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3, 203, 410. 52
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2, 412, 000. 00
减：应计利息总额	578. 12
减：交易费用	128. 46
买卖债券差价收入	790, 703. 94

#### 6. 4. 7. 15. 3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

#### 6. 4. 7. 15. 4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 6. 4. 7. 16 资产支持证券投资收益

##### 6. 4. 7. 16. 1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

##### 6. 4. 7. 16. 2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

##### 6. 4. 7. 16. 3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6. 4. 7. 16. 4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

#### 6. 4. 7. 17 贵金属投资收益

##### 6. 4. 7. 17. 1 贵金属投资收益项目构成

无。

##### 6. 4. 7. 17. 2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

**6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

无。

**6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

无。

**6.4.7.18 衍生工具收益****6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无。

**6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-1,290,795.97

**6.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	59,523,611.91
其中：证券出借权益补偿收入	9,468,455.05
基金投资产生的股利收益	-
合计	59,523,611.91

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	310,214,656.41
股票投资	310,214,656.41
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	3,309,560.00
权证投资	-
期货投资	3,309,560.00
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	313,524,216.41

## 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	8,213,087.21
合计	8,213,087.21

## 6.4.7.22 信用减值损失

无。

## 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	48,596.69
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	510.00
指数使用费	826,962.55
其他	49.00
存托服务费	1,437.91
合计	937,063.52

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 6.4.8.1 或有事项

无。

## 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

## 6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

## 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
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
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

## 6.4.10 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。

**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

无。

**6.4.10.1.2 债券交易**

无。

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

无。

**6.4.10.1.4 权证交易**

无。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

无。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,134,812.88	2,307,528.74
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。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,378,270.99	769,176.23

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。

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易**

无。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022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	352,967,008.00	34.17	355,502,628.00	25.79

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限 公司_活期	73,745,343.85	110,173.10	20,677,117.03	48,822.45

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

本期(2023年1月1日至2023年6月30日),本基金未实施利润分配。

## 6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001282	三联锻造	2023年5月15日	6个月	新股锁定	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001286	陕西能源	2023年3月31日	6个月	新股锁定	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023年3月30日	6个月	新股锁定	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	-
001324	长青科技	2023年5月12日	6个月	新股锁定	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001328	登康口腔	2023年3月29日	6个月	新股锁定	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023年3月31日	6个月	新股锁定	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001367	海森药业	2023年3月30日	6个月	新股锁定	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
001380	华纬科技	2023年5月9日	6个月	新股锁定	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-
300804	广康生化	2023年6月15日	6个月	新股锁定	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-
301141	中科磁业	2023年3月27日	6个月	新股锁定	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301157	华塑科技	2023年3月1日	6个月	新股锁定	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301170	锡南科技	2023年6月16日	6个月	新股锁定	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-

301202	朗威股份	2023年6月28日	1个月内(含)	新发未上市	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股锁定	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
301203	国泰环保	2023年3月28日	6个月	新股锁定	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
301225	恒勃股份	2023年6月8日	6个月	新股锁定	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-
301246	宏源药业	2023年3月10日	6个月	新股锁定	50.00	30.71	931	46,550.00	28,591.01	-
301260	格力博	2023年1月20日	6个月	新股锁定	30.85	23.63	3,121	96,282.85	73,749.23	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	1个月内(含)	新发未上市	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股锁定	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
301262	海看股份	2023年6月13日	6个月	新股锁定	30.22	25.50	692	20,912.24	17,646.00	-
301293	三博脑科	2023年4月25日	6个月	新股锁定	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301295	美硕科技	2023年6月19日	6个月	新股锁定	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-
301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月	新股锁定	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04	-
301303	真兰仪表	2023年2月13日	6个月	新股锁定	26.80	22.32	1,058	28,354.40	23,614.56	-
301310	鑫宏业	2023年5月26日	6个月	新股锁定	67.28	65.43	409	27,517.52	26,760.87	-
301315	威士顿	2023年6月13日	6个月	新股锁定	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-

		日									
301317	鑫磊股份	2023年1月12日	6个月	新股锁定	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98		-
301320	豪江智能	2023年6月1日	6个月	新股锁定	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04		-
301322	绿通科技	2023年2月27日	6个月	新股锁定	131.11	53.24	392	34,219.71	20,870.08		-
301323	新莱福	2023年5月29日	6个月	新股锁定	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08		-
301332	德尔玛	2023年5月9日	6个月	新股锁定	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06		-
301337	亚华电子	2023年5月16日	6个月	新股锁定	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84		-
301355	南王科技	2023年6月2日	6个月	新股锁定	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25		-
301357	北方长龙	2023年4月11日	6个月	新股锁定	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10		-
301358	湖南裕能	2023年2月1日	6个月	新股锁定	23.77	42.89	2,023	48,086.71	86,766.47		-
301360	荣旗科技	2023年4月17日	6个月	新股锁定	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40		-
301373	凌玮科技	2023年1月20日	6个月	新股锁定	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45		-
301376	致欧科技	2023年6月14日	6个月	新股锁定	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20		-
301382	蜂助手	2023年5月9日	6个月	新股锁定	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72		-
301383	天键股份	2023年5月31日	6个月	新股锁定	46.16	35.72	493	22,756.88	17,609.96		-
301386	未来	2023年	6个月	新股锁	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62		-



	电器	3月21日		定							
301395	仁信新材	2023年6月21日	1个月内(含)	新发未上市	26.68	26.68	4,676	124,755.68	124,755.68		-
301395	仁信新材	2023年6月21日	6个月	新股锁定	26.68	26.68	520	13,873.60	13,873.60		-
301408	华人健康	2023年2月22日	6个月	新股锁定	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05		-
301419	阿莱德	2023年2月2日	6个月	新股锁定	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50		-
301428	世纪恒通	2023年5月10日	6个月	新股锁定	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40		-
301439	泓淋电力	2023年3月10日	6个月	新股锁定	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10		-
601061	中信金属	2023年3月30日	6个月	新股锁定	6.58	7.58	4,016	26,425.28	30,441.28		-
601065	江盐集团	2023年3月31日	6个月	新股锁定	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00		-
601133	柏诚股份	2023年3月31日	6个月	新股锁定	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64		-
603125	常青科技	2023年3月30日	6个月	新股锁定	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80		-
603172	万丰股份	2023年4月28日	6个月	新股锁定	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86		-
688146	中船特气	2023年4月13日	6个月	新股锁定	36.15	38.13	1,011	36,547.65	38,549.43		-
688249	晶合集成	2023年4月24日	6个月	新股锁定	19.86	18.06	7,405	147,063.30	133,734.30		-
688334	西高院	2023年6月9日	6个月	新股锁定	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48		-

688352	顾中科技	2023年4月11日	6个月	新股锁定	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-
688361	中科飞测	2023年5月12日	6个月	新股锁定	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-
688429	时创能源	2023年6月20日	6个月	新股锁定	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
688433	华曙高科	2023年4月7日	6个月	新股锁定	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-
688458	美芯晟	2023年5月15日	6个月	新股锁定	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	-
688469	中芯集成	2023年4月28日	6个月	新股锁定	5.69	5.41	13,800	78,522.00	74,658.00	-
688472	阿特斯	2023年6月2日	6个月	新股锁定	11.10	17.04	6,261	69,497.10	106,687.44	-
688478	晶升股份	2023年4月13日	6个月	新股锁定	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74	-
688479	友车科技	2023年5月4日	6个月	新股锁定	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
688484	南芯科技	2023年3月28日	6个月	新股锁定	39.99	36.71	1,008	40,309.92	37,003.68	-
688507	索辰科技	2023年4月10日	6个月	新股锁定	245.56	122.11	222	36,834.00	27,108.42	-
688512	慧智微	2023年5月8日	6个月	新股锁定	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-
688523	航天环宇	2023年5月26日	6个月	新股锁定	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-
688535	华海诚科	2023年3月28日	6个月	新股锁定	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
688543	国科军工	2023年6月14日	6个月	新股锁定	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-

688552	航天南湖	2023年5月8日	6个月	新股锁定	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	-
688562	航天软件	2023年5月15日	6个月	新股锁定	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
688570	天玛智控	2023年5月29日	6个月	新股锁定	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72	-
688576	西山科技	2023年5月30日	6个月	新股锁定	135.80	120.41	240	32,592.00	28,898.40	-
688581	安杰思	2023年5月12日	6个月	新股锁定	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股锁定	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
688593	新相微	2023年5月25日	6个月	新股锁定	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-
688603	天承科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新发未上市	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-
688603	天承科技	2023年6月30日	6个月	新股锁定	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
688620	安凯微	2023年6月15日	6个月	新股锁定	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
688623	二元科技	2023年5月31日	6个月	新股锁定	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-
688629	华丰科技	2023年6月16日	6个月	新股锁定	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信息	2023年6月19日	6个月	新股锁定	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-

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。

## 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601298	青岛港	2023年6月28日	重大事项停牌	6.97	2023年07月03日	7.40	659,500	4,311,393.71	4,596,715.00	-
000540	*ST中天	2023年05月19日	退市	0.40	-	-	3,046,725	4,150,777.45	1,218,690.00	-

## 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

## 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

## 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

## 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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	300308	中际旭创	2023年7月4日-2023年7月11日	147.45	104,500	15,408,525.00
2	688256	寒武纪	2023年7月4日-2023年7月11日	188	34,100	6,410,800.00
3	000988	华工科技	2023年7月4日-2023年7月11日	38.01	163,900	6,229,839.00
4	002340	格林美	2023年7月4日-2023年7月11日	6.91	837,100	5,784,361.00
5	002384	东山精密	2023年7月4日-2023年7月11日	25.9	222,700	5,767,930.00
6	002422	科伦药业	2023年7月4日-2023年7月11日	29.68	191,900	5,695,592.00
7	600372	中航电子	2023年7月4日-2023年7月11日	15.18	365,200	5,543,736.00
8	300418	昆仑万	2023年7月4日-2023年	40.28	136,400	5,494,192

		维	7月11日			.00
9	300012	华测检测	2023年7月4日-2023年7月11日	19.5	274,400	5,350,800.00
10	600157	永泰能源	2023年7月4日-2023年7月11日	1.42	3,620,600	5,141,252.00
11	300724	捷佳伟创	2023年7月4日-2023年7月11日	112.35	45,600	5,123,160.00
12	600079	人福医药	2023年7月4日-2023年7月11日	26.94	186,400	5,021,616.00
13	600489	中金黄金	2023年7月4日-2023年7月11日	10.33	474,100	4,897,453.00
14	300003	乐普医疗	2023年7月4日-2023年7月11日	22.61	214,500	4,849,845.00
15	002738	中矿资源	2023年7月4日-2023年7月11日	50.94	92,900	4,732,326.00
16	600487	亨通光电	2023年7月4日-2023年7月11日	14.66	321,700	4,716,122.00
17	002028	思源电气	2023年7月4日-2023年7月11日	46.72	100,100	4,676,672.00
18	600536	中国软件	2023年7月4日-2023年7月11日	46.88	97,900	4,589,552.00
19	002463	沪电股份	2023年7月4日-2023年7月11日	20.94	217,200	4,548,168.00
20	601058	赛轮轮胎	2023年7月4日-2023年7月11日	11.39	399,300	4,548,027.00
21	601555	东吴证券	2023年7月4日-2023年7月11日	6.94	652,800	4,530,432.00
22	600765	中航重机	2023年7月4日-2023年7月11日	26.51	167,700	4,445,727.00
23	300037	新宙邦	2023年7月4日-2023年7月11日	51.89	85,200	4,421,028.00
24	000066	中国长城	2023年7月4日-2023年7月11日	13.83	315,100	4,357,833.00
25	600885	宏发股份	2023年7月4日-2023年7月11日	31.85	135,800	4,325,230.00
26	000807	云铝股份	2023年7月4日-2023年7月11日	12.73	339,300	4,319,289.00
27	600482	中国动力	2023年7月4日-2023年7月11日	23.44	176,000	4,125,440.00
28	000009	中国宝安	2023年7月4日-2023年7月11日	12.07	336,000	4,055,520.00
29	000423	东阿阿胶	2023年7月4日-2023年7月11日	53.45	74,800	3,998,060.00
30	688777	中控技	2023年7月4日-2023年	62.78	63,600	3,992,808

		术	7月11日			.00
31	688099	晶晨股份	2023年7月4日-2023年7月11日	84.32	47,300	3,988,336.00
32	300146	汤臣倍健	2023年7月4日-2023年7月11日	23.98	166,100	3,983,078.00
33	600352	浙江龙盛	2023年7月4日-2023年7月11日	9.35	424,000	3,964,400.00
34	300058	蓝色光标	2023年7月4日-2023年7月11日	9.67	405,900	3,925,053.00
35	002966	苏州银行	2023年7月4日-2023年7月11日	6.55	597,300	3,912,315.00
36	002156	通富微电	2023年7月4日-2023年7月11日	22.6	172,700	3,903,020.00
37	002185	华天科技	2023年7月4日-2023年7月11日	9.2	418,000	3,845,600.00
38	601108	财通证券	2023年7月4日-2023年7月11日	7.24	529,600	3,834,304.00
39	600415	小商品城	2023年7月4日-2023年7月11日	8.53	447,100	3,813,763.00
40	002625	光启技术	2023年7月4日-2023年7月11日	15.26	245,800	3,750,908.00
41	002624	完美世界	2023年7月4日-2023年7月11日	16.89	221,100	3,734,379.00
42	600027	华电国际	2023年7月4日-2023年7月11日	6.69	554,900	3,712,281.00
43	300144	宋城演艺	2023年7月4日-2023年7月11日	12.4	297,000	3,682,800.00
44	600109	国金证券	2023年7月4日-2023年7月11日	8.67	422,900	3,666,543.00
45	000783	长江证券	2023年7月4日-2023年7月11日	5.8	630,800	3,658,640.00
46	600988	赤峰黄金	2023年7月4日-2023年7月11日	13.46	271,100	3,649,006.00
47	601233	桐昆股份	2023年7月4日-2023年7月11日	13.25	275,000	3,643,750.00
48	600161	天坛生物	2023年7月4日-2023年7月11日	27.15	134,200	3,643,530.00
49	601077	渝农商行	2023年7月4日-2023年7月11日	3.59	1,008,700	3,621,233.00
50	300568	星源材质	2023年7月4日-2023年7月11日	17.19	209,000	3,592,710.00
51	600418	江淮汽车	2023年7月4日-2023年7月11日	12.59	284,900	3,586,891.00
52	002008	大族激光	2023年7月4日-2023年7月11日	26.2	136,900	3,586,780.00

		光	7月11日			.00
53	300285	国瓷材料	2023年7月4日-2023年7月11日	27.4	130,900	3,586,660.00
54	600298	安琪酵母	2023年7月4日-2023年7月11日	36.21	99,000	3,584,790.00
55	600096	云天化	2023年7月4日-2023年7月11日	17.07	209,000	3,567,630.00
56	002385	大北农	2023年7月4日-2023年7月11日	6.6	539,500	3,560,700.00
57	002223	鱼跃医疗	2023年7月4日-2023年7月11日	35.99	97,900	3,523,421.00
58	603444	吉比特	2023年7月4日-2023年7月11日	491.11	7,100	3,486,881.00
59	000630	铜陵有色	2023年7月4日-2023年7月11日	2.89	1,200,600	3,469,734.00
60	002407	多氟多	2023年7月4日-2023年7月11日	19.86	174,300	3,461,598.00
61	600862	中航高科	2023年7月4日-2023年7月11日	25.31	136,400	3,452,284.00
62	603882	金域医学	2023年7月4日-2023年7月11日	75.5	45,600	3,442,800.00
63	300390	天华新能	2023年7月4日-2023年7月11日	35.8	95,700	3,426,060.00
64	002409	雅克科技	2023年7月4日-2023年7月11日	72.88	46,700	3,403,496.00
65	603688	石英股份	2023年7月4日-2023年7月11日	113.84	29,700	3,381,048.00
66	601162	天风证券	2023年7月4日-2023年7月11日	2.98	1,129,700	3,366,506.00
67	300024	机器人	2023年7月4日-2023年7月11日	16.67	201,800	3,364,006.00
68	002497	雅化集团	2023年7月4日-2023年7月11日	17.78	188,100	3,344,418.00
69	000933	神火股份	2023年7月4日-2023年7月11日	13	256,800	3,338,400.00
70	300073	当升科技	2023年7月4日-2023年7月11日	50.33	66,000	3,321,780.00
71	300474	景嘉微	2023年7月4日-2023年7月11日	89.99	36,800	3,311,632.00
72	002240	盛新锂能	2023年7月4日-2023年7月11日	31.87	103,900	3,311,293.00
73	600705	中航产融	2023年7月4日-2023年7月11日	3.83	863,500	3,307,205.00
74	300395	菲利华	2023年7月4日-2023年	49.2	67,100	3,301,320

			7月11日			.00
75	300604	长川科技	2023年7月4日-2023年7月11日	47.49	69,300	3,291,057.00
76	601168	西部矿业	2023年7月4日-2023年7月11日	10.51	310,700	3,265,457.00
77	002439	启明星辰	2023年7月4日-2023年7月11日	29.76	108,900	3,240,864.00
78	605358	立昂微	2023年7月4日-2023年7月11日	36.73	88,000	3,232,240.00
79	000932	华菱钢铁	2023年7月4日-2023年7月11日	4.77	675,400	3,221,658.00
80	600066	宇通客车	2023年7月4日-2023年7月11日	14.74	216,700	3,194,158.00
81	000975	银泰黄金	2023年7月4日-2023年7月11日	11.7	271,700	3,178,890.00
82	603596	伯特利	2023年7月4日-2023年7月11日	79.26	40,100	3,178,326.00
83	002600	领益智造	2023年7月4日-2023年7月11日	6.91	458,700	3,169,617.00
84	300136	信维通信	2023年7月4日-2023年7月11日	20.08	157,800	3,168,624.00
85	600060	海信视像	2023年7月4日-2023年7月11日	24.75	127,600	3,158,100.00
86	002138	顺络电子	2023年7月4日-2023年7月11日	23.91	131,400	3,141,774.00
87	002797	第一创业	2023年7月4日-2023年7月11日	5.72	547,800	3,133,416.00
88	002568	百润股份	2023年7月4日-2023年7月11日	36.35	85,800	3,118,830.00
89	002465	海格通信	2023年7月4日-2023年7月11日	10.34	300,300	3,105,102.00
90	603816	顾家家居	2023年7月4日-2023年7月11日	38.15	80,300	3,063,445.00
91	002850	科达利	2023年7月4日-2023年7月11日	132.25	23,100	3,054,975.00
92	603939	益丰药房	2023年7月4日-2023年7月11日	37	82,500	3,052,500.00
93	601128	常熟银行	2023年7月4日-2023年7月11日	6.82	446,600	3,045,812.00
94	000021	深科技	2023年7月4日-2023年7月11日	19.99	152,300	3,044,477.00
95	600839	四川长虹	2023年7月4日-2023年7月11日	5.05	601,700	3,038,585.00
96	600160	巨化股	2023年7月4日-2023年	13.78	220,000	3,031,600



		份	7月11日			.00
97	300253	卫宁健康	2023年7月4日-2023年7月11日	10.82	279,900	3,028,518.00
98	000591	太阳能	2023年7月4日-2023年7月11日	6.78	446,000	3,023,880.00
99	600563	法拉电子	2023年7月4日-2023年7月11日	137.3	22,000	3,020,600.00
100	600879	航天电子	2023年7月4日-2023年7月11日	8.49	354,700	3,011,403.00
101	688567	孚能科技	2023年7月4日-2023年7月11日	21.59	139,100	3,003,169.00
102	600873	梅花生物	2023年7月4日-2023年7月11日	8.93	335,500	2,996,015.00
103	300832	新产业	2023年7月4日-2023年7月11日	59	50,600	2,985,400.00
104	688169	石头科技	2023年7月4日-2023年7月11日	320.68	9,300	2,982,324.00
105	000683	远兴能源	2023年7月4日-2023年7月11日	7.19	413,000	2,969,470.00
106	601990	南京证券	2023年7月4日-2023年7月11日	8.18	360,200	2,946,436.00
107	600392	盛和资源	2023年7月4日-2023年7月11日	12.87	228,200	2,936,934.00
108	688521	芯原股份	2023年7月4日-2023年7月11日	71.92	40,700	2,927,144.00
109	002078	太阳纸业	2023年7月4日-2023年7月11日	10.69	273,300	2,921,577.00
110	002368	太极股份	2023年7月4日-2023年7月11日	41.17	70,900	2,918,953.00
111	300699	光威复材	2023年7月4日-2023年7月11日	30.85	94,600	2,918,410.00
112	600497	驰宏锌锗	2023年7月4日-2023年7月11日	5.02	580,800	2,915,616.00
113	603589	口子窖	2023年7月4日-2023年7月11日	49.35	58,800	2,901,780.00
114	601696	中银证券	2023年7月4日-2023年7月11日	10.66	271,700	2,896,322.00
115	300866	安克创新	2023年7月4日-2023年7月11日	87.5	33,000	2,887,500.00
116	000729	燕京啤酒	2023年7月4日-2023年7月11日	12.47	229,900	2,866,853.00
117	300118	东方日升	2023年7月4日-2023年7月11日	25.63	111,600	2,860,308.00
118	600177	雅戈尔	2023年7月4日-2023年	6.31	452,600	2,855,906

			7月11日			.00
119	600516	方大炭素	2023年7月4日-2023年7月11日	6.2	459,200	2,847,040.00
120	002025	航天电器	2023年7月4日-2023年7月11日	63.8	44,500	2,839,100.00
121	688390	固德威	2023年7月4日-2023年7月11日	166.86	17,000	2,836,620.00
122	000831	中国稀土	2023年7月4日-2023年7月11日	29.6	95,700	2,832,720.00
123	002294	信立泰	2023年7月4日-2023年7月11日	31.19	90,700	2,828,933.00
124	600141	兴发集团	2023年7月4日-2023年7月11日	22.22	127,000	2,821,940.00
125	300017	网宿科技	2023年7月4日-2023年7月11日	7.11	394,900	2,807,739.00
126	600642	申能股份	2023年7月4日-2023年7月11日	6.99	399,800	2,794,602.00
127	000728	国元证券	2023年7月4日-2023年7月11日	6.52	426,800	2,782,736.00
128	002673	西部证券	2023年7月4日-2023年7月11日	6.35	437,200	2,776,220.00
129	002430	杭氧股份	2023年7月4日-2023年7月11日	34.36	80,300	2,759,108.00
130	600699	均胜电子	2023年7月4日-2023年7月11日	17.64	156,200	2,755,368.00
131	000629	钒钛股份	2023年7月4日-2023年7月11日	3.91	700,700	2,739,737.00
132	600170	上海建工	2023年7月4日-2023年7月11日	2.69	1,013,600	2,726,584.00
133	002532	天山铝业	2023年7月4日-2023年7月11日	5.99	454,800	2,724,252.00
134	600325	华发股份	2023年7月4日-2023年7月11日	9.85	276,100	2,719,585.00
135	600118	中国卫星	2023年7月4日-2023年7月11日	28.21	96,200	2,713,802.00
136	002273	水晶光电	2023年7月4日-2023年7月11日	11.94	226,600	2,705,604.00
137	002195	二三四五	2023年7月4日-2023年7月11日	2.89	932,800	2,695,792.00
138	002268	电科网安	2023年7月4日-2023年7月11日	27.87	96,200	2,681,094.00
139	601966	玲珑轮胎	2023年7月4日-2023年7月11日	22.22	120,400	2,675,288.00
140	600521	华海药	2023年7月4日-2023年	18.41	145,200	2,673,132

		业	7月11日			.00
141	600153	建发股份	2023年7月4日-2023年7月11日	10.91	244,700	2,669,677.00
142	002739	万达电影	2023年7月4日-2023年7月11日	12.54	212,800	2,668,512.00
143	002372	伟星新材	2023年7月4日-2023年7月11日	20.54	129,800	2,666,092.00
144	600166	福田汽车	2023年7月4日-2023年7月11日	3.4	782,600	2,660,840.00
145	000400	许继电气	2023年7月4日-2023年7月11日	23.05	114,900	2,648,445.00
146	600486	扬农化工	2023年7月4日-2023年7月11日	87.42	30,200	2,640,084.00
147	300595	欧普康视	2023年7月4日-2023年7月11日	30.19	87,400	2,638,606.00
148	600549	厦门钨业	2023年7月4日-2023年7月11日	19.03	138,600	2,637,558.00
149	000998	隆平高科	2023年7月4日-2023年7月11日	15.35	171,600	2,634,060.00
150	603000	人民网	2023年7月4日-2023年7月11日	29.2	90,200	2,633,840.00
151	600399	抚顺特钢	2023年7月4日-2023年7月11日	10.2	256,800	2,619,360.00
152	000738	航发控制	2023年7月4日-2023年7月11日	24.4	107,200	2,615,680.00
153	688002	睿创微纳	2023年7月4日-2023年7月11日	44.8	58,300	2,611,840.00
154	600637	东方明珠	2023年7月4日-2023年7月11日	7.82	333,800	2,610,316.00
155	002065	东华软件	2023年7月4日-2023年7月11日	7.06	365,700	2,581,842.00
156	600143	金发科技	2023年7月4日-2023年7月11日	8.73	295,300	2,577,969.00
157	002444	巨星科技	2023年7月4日-2023年7月11日	21.88	117,700	2,575,276.00
158	689009	九号公司	2023年7月4日-2023年7月11日	36.85	69,800	2,572,130.00
159	688220	翱捷科技	2023年7月4日-2023年7月11日	75.39	34,100	2,570,799.00
160	600481	双良节能	2023年7月4日-2023年7月11日	13.98	183,100	2,559,738.00
161	600859	王府井	2023年7月4日-2023年7月11日	19.79	129,200	2,556,868.00
162	688072	拓荆科	2023年7月4日-2023年	425.97	6,000	2,555,820.00

		技	7月11日			.00
163	000997	新大陆	2023年7月4日-2023年7月11日	18.9	134,700	2,545,830.00
164	601577	长沙银行	2023年7月4日-2023年7月11日	7.76	327,800	2,543,728.00
165	300438	鹏辉能源	2023年7月4日-2023年7月11日	48.04	52,800	2,536,512.00
166	601198	东兴证券	2023年7月4日-2023年7月11日	8.02	316,200	2,535,924.00
167	002131	利欧股份	2023年7月4日-2023年7月11日	2.3	1,100,500	2,531,150.00
168	002353	杰瑞股份	2023年7月4日-2023年7月11日	25.13	100,600	2,528,078.00
169	600499	科达制造	2023年7月4日-2023年7月11日	11.36	222,200	2,524,192.00
170	300383	光环新网	2023年7月4日-2023年7月11日	10.75	234,300	2,518,725.00
171	600704	物产中大	2023年7月4日-2023年7月11日	4.94	508,200	2,510,508.00
172	688536	思瑞浦	2023年7月4日-2023年7月11日	218	11,500	2,507,000.00
173	000960	锡业股份	2023年7月4日-2023年7月11日	15.55	161,100	2,505,105.00
174	300682	朗新科技	2023年7月4日-2023年7月11日	23.28	107,200	2,495,616.00
175	600271	航天信息	2023年7月4日-2023年7月11日	13.69	180,900	2,476,521.00
176	600021	上海电力	2023年7月4日-2023年7月11日	10.77	229,300	2,469,561.00
177	300001	特锐德	2023年7月4日-2023年7月11日	20.78	118,800	2,468,664.00
178	000519	中兵红箭	2023年7月4日-2023年7月11日	18.09	136,400	2,467,476.00
179	002373	千方科技	2023年7月4日-2023年7月11日	13.64	180,400	2,460,656.00
180	603077	和邦生物	2023年7月4日-2023年7月11日	2.43	1,007,600	2,448,468.00
181	688009	中国通号	2023年7月4日-2023年7月11日	5.8	421,300	2,443,540.00
182	300676	华大基因	2023年7月4日-2023年7月11日	59.99	40,700	2,441,593.00
183	000623	吉林敖东	2023年7月4日-2023年7月11日	16.04	151,800	2,434,872.00
184	000703	恒逸石	2023年7月4日-2023年	6.78	358,600	2,431,308

		化	7月11日			.00
185	002056	横店东磁	2023年7月4日-2023年7月11日	18.21	132,500	2,412,825.00
186	300088	长信科技	2023年7月4日-2023年7月11日	6.03	399,800	2,410,794.00
187	600380	健康元	2023年7月4日-2023年7月11日	12.71	188,600	2,397,106.00
188	688516	奥特维	2023年7月4日-2023年7月11日	188.4	12,600	2,373,840.00
189	000513	丽珠集团	2023年7月4日-2023年7月11日	38.91	61,000	2,373,510.00
190	002281	光迅科技	2023年7月4日-2023年7月11日	37.09	63,800	2,366,342.00
191	600998	九州通	2023年7月4日-2023年7月11日	10.38	227,821	2,364,781.98
192	600498	烽火通信	2023年7月4日-2023年7月11日	20.37	116,000	2,362,920.00
193	600511	国药股份	2023年7月4日-2023年7月11日	38.85	60,500	2,350,425.00
194	600529	山东药玻	2023年7月4日-2023年7月11日	27.22	86,300	2,349,086.00
195	600546	山煤国际	2023年7月4日-2023年7月11日	14.47	161,700	2,339,799.00
196	002152	广电运通	2023年7月4日-2023年7月11日	11.72	199,100	2,333,452.00
197	002203	海亮股份	2023年7月4日-2023年7月11日	12.01	194,100	2,331,141.00
198	601997	贵阳银行	2023年7月4日-2023年7月11日	5.16	451,500	2,329,740.00
199	002299	圣农发展	2023年7月4日-2023年7月11日	19.15	121,500	2,326,725.00
200	601016	节能风电	2023年7月4日-2023年7月11日	3.67	633,000	2,323,110.00
201	600867	通化东宝	2023年7月4日-2023年7月11日	10.44	222,200	2,319,768.00
202	688301	奕瑞科技	2023年7月4日-2023年7月11日	282.43	8,200	2,315,926.00
203	000636	风华高科	2023年7月4日-2023年7月11日	15.34	150,700	2,311,738.00
204	603338	浙江鼎力	2023年7月4日-2023年7月11日	56.01	41,200	2,307,612.00
205	002595	豪迈科技	2023年7月4日-2023年7月11日	35.13	65,400	2,297,502.00
206	600739	辽宁成	2023年7月4日-2023年	13.15	174,300	2,292,045

		大	7月11日			.00
207	603517	绝味食品	2023年7月4日-2023年7月11日	37.15	61,600	2,288,440.00
208	002192	融捷股份	2023年7月4日-2023年7月11日	66.83	34,100	2,278,903.00
209	603712	七一二	2023年7月4日-2023年7月11日	30.21	75,300	2,274,813.00
210	601636	旗滨集团	2023年7月4日-2023年7月11日	8.62	262,300	2,261,026.00
211	603927	中科软	2023年7月4日-2023年7月11日	38.56	58,300	2,248,048.00
212	002080	中材科技	2023年7月4日-2023年7月11日	20.52	109,400	2,244,888.00
213	002531	天顺风能	2023年7月4日-2023年7月11日	15.23	146,800	2,235,764.00
214	002506	协鑫集成	2023年7月4日-2023年7月11日	2.93	762,800	2,235,004.00
215	002432	九安医疗	2023年7月4日-2023年7月11日	35.21	63,200	2,225,272.00
216	603885	吉祥航空	2023年7月4日-2023年7月11日	15.43	144,100	2,223,463.00
217	600863	内蒙华电	2023年7月4日-2023年7月11日	4.15	531,800	2,206,970.00
218	688772	珠海冠宇	2023年7月4日-2023年7月11日	20.15	109,400	2,204,410.00
219	600970	中材国际	2023年7月4日-2023年7月11日	12.75	172,100	2,194,275.00
220	600580	卧龙电驱	2023年7月4日-2023年7月11日	14.61	150,100	2,192,961.00
221	600655	豫园股份	2023年7月4日-2023年7月11日	6.86	317,900	2,180,794.00
222	002092	中泰化学	2023年7月4日-2023年7月11日	6.45	337,700	2,178,165.00
223	688385	复旦微电	2023年7月4日-2023年7月11日	50.1	43,400	2,174,340.00
224	300182	捷成股份	2023年7月4日-2023年7月11日	6.31	343,700	2,168,747.00
225	000878	云南铜业	2023年7月4日-2023年7月11日	11.05	195,800	2,163,590.00
226	300212	易华录	2023年7月4日-2023年7月11日	33.23	64,900	2,156,627.00
227	600820	隧道股份	2023年7月4日-2023年7月11日	6.01	358,600	2,155,186.00
228	300296	利亚德	2023年7月4日-2023年	6.53	330,000	2,154,900.00

			7月11日			.00
229	002683	广东宏大	2023年7月4日-2023年7月11日	29.44	73,100	2,152,064.00
230	600528	中铁工业	2023年7月4日-2023年7月11日	9.88	217,200	2,145,936.00
231	600909	华安证券	2023年7月4日-2023年7月11日	4.67	459,200	2,144,464.00
232	002939	长城证券	2023年7月4日-2023年7月11日	8.13	262,900	2,137,377.00
233	002926	华西证券	2023年7月4日-2023年7月11日	8.31	256,800	2,134,008.00
234	600535	天士力	2023年7月4日-2023年7月11日	14.51	146,800	2,130,068.00
235	300487	蓝晓科技	2023年7月4日-2023年7月11日	62.42	33,750	2,106,675.00
236	002507	涪陵榨菜	2023年7月4日-2023年7月11日	18.31	115,000	2,105,650.00
237	300244	迪安诊断	2023年7月4日-2023年7月11日	25.63	81,900	2,099,097.00
238	300748	金力永磁	2023年7月4日-2023年7月11日	29.92	69,800	2,088,416.00
239	000547	航天发展	2023年7月4日-2023年7月11日	10	208,400	2,084,000.00
240	000893	亚钾国际	2023年7月4日-2023年7月11日	22.94	90,700	2,080,658.00
241	000750	国海证券	2023年7月4日-2023年7月11日	3.35	620,900	2,080,015.00
242	600329	达仁堂	2023年7月4日-2023年7月11日	44.89	46,200	2,073,918.00
243	600258	首旅酒店	2023年7月4日-2023年7月11日	18.95	109,400	2,073,130.00
244	000039	中集集团	2023年7月4日-2023年7月11日	6.89	300,300	2,069,067.00
245	600008	首创环保	2023年7月4日-2023年7月11日	2.88	717,700	2,066,976.00
246	603160	汇顶科技	2023年7月4日-2023年7月11日	46.25	44,500	2,058,125.00
247	600416	湘电股份	2023年7月4日-2023年7月11日	19.09	107,800	2,057,902.00
248	002557	洽洽食品	2023年7月4日-2023年7月11日	41.55	49,500	2,056,725.00
249	603156	养元饮品	2023年7月4日-2023年7月11日	24.7	82,500	2,037,750.00
250	000970	中科三	2023年7月4日-2023年	12.82	158,400	2,030,688

		环	7月11日			.00
251	002429	兆驰股份	2023年7月4日-2023年7月11日	5.5	369,000	2,029,500.00
252	000060	中金岭南	2023年7月4日-2023年7月11日	4.75	426,200	2,024,450.00
253	688200	华峰测控	2023年7月4日-2023年7月11日	153	13,200	2,019,600.00
254	601991	大唐发电	2023年7月4日-2023年7月11日	3.31	606,100	2,006,191.00
255	603893	瑞芯微	2023年7月4日-2023年7月11日	72.85	27,500	2,003,375.00
256	603456	九洲药业	2023年7月4日-2023年7月11日	27.38	73,100	2,001,478.00
257	000830	鲁西化工	2023年7月4日-2023年7月11日	10.56	188,100	1,986,336.00
258	600369	西南证券	2023年7月4日-2023年7月11日	3.65	541,200	1,975,380.00
259	600390	五矿资本	2023年7月4日-2023年7月11日	5.38	366,300	1,970,694.00
260	600435	北方导航	2023年7月4日-2023年7月11日	11.49	171,000	1,964,790.00
261	002508	老板电器	2023年7月4日-2023年7月11日	25.29	77,500	1,959,975.00
262	002500	山西证券	2023年7月4日-2023年7月11日	5.58	350,900	1,958,022.00
263	300558	贝达药业	2023年7月4日-2023年7月11日	48.03	40,700	1,954,821.00
264	600398	海澜之家	2023年7月4日-2023年7月11日	6.88	281,600	1,937,408.00
265	603658	安图生物	2023年7月4日-2023年7月11日	51.73	37,400	1,934,702.00
266	002128	电投能源	2023年7月4日-2023年7月11日	13.22	146,300	1,934,086.00
267	002936	郑州银行	2023年7月4日-2023年7月11日	2.3	838,200	1,927,860.00
268	601880	辽港股份	2023年7月4日-2023年7月11日	1.56	1,227,600	1,915,056.00
269	603737	三棵树	2023年7月4日-2023年7月11日	65.42	29,180	1,908,955.60
270	300009	安科生物	2023年7月4日-2023年7月11日	10	190,800	1,908,000.00
271	600038	中直股份	2023年7月4日-2023年7月11日	39.82	47,800	1,903,396.00
272	600348	华阳股	2023年7月4日-2023年	7.91	240,300	1,900,773



		份	7月11日			.00
273	300070	碧水源	2023年7月4日-2023年7月11日	5.36	354,200	1,898,512.00
274	600848	上海临港	2023年7月4日-2023年7月11日	11.95	156,200	1,866,590.00
275	603858	步长制药	2023年7月4日-2023年7月11日	20.59	90,200	1,857,218.00
276	300026	红日药业	2023年7月4日-2023年7月11日	5.42	342,600	1,856,892.00
277	000050	深天马A	2023年7月4日-2023年7月11日	9.18	200,200	1,837,836.00
278	300529	健帆生物	2023年7月4日-2023年7月11日	23.18	79,200	1,835,856.00
279	002572	索菲亚	2023年7月4日-2023年7月11日	17.42	103,900	1,809,938.00
280	601179	中国西电	2023年7月4日-2023年7月11日	5.41	334,400	1,809,104.00
281	603127	昭衍新药	2023年7月4日-2023年7月11日	40.9	44,000	1,799,600.00
282	002244	滨江集团	2023年7月4日-2023年7月11日	8.82	202,900	1,789,578.00
283	601717	郑煤机	2023年7月4日-2023年7月11日	12.45	143,500	1,786,575.00
284	300373	扬杰科技	2023年7月4日-2023年7月11日	40.57	44,000	1,785,080.00
285	688779	长远锂科	2023年7月4日-2023年7月11日	11.27	157,300	1,772,771.00
286	600673	东阳光	2023年7月4日-2023年7月11日	7.21	245,800	1,772,218.00
287	601456	国联证券	2023年7月4日-2023年7月11日	9.1	194,700	1,771,770.00
288	002408	齐翔腾达	2023年7月4日-2023年7月11日	6.37	277,700	1,768,949.00
289	002266	浙富控股	2023年7月4日-2023年7月11日	4.13	427,300	1,764,749.00
290	601958	金钼股份	2023年7月4日-2023年7月11日	11.15	157,800	1,759,470.00
291	003035	南网能源	2023年7月4日-2023年7月11日	7.12	246,900	1,757,928.00
292	688188	柏楚电子	2023年7月4日-2023年7月11日	188.56	9,300	1,753,608.00
293	600895	张江高科	2023年7月4日-2023年7月11日	13.92	125,900	1,752,528.00
294	002019	亿帆医	2023年7月4日-2023年	14.6	119,900	1,750,540

		药	7月11日			.00
295	600827	百联股份	2023年7月4日-2023年7月11日	13.37	130,900	1,750,133.00
296	600667	太极实业	2023年7月4日-2023年7月11日	7.26	240,300	1,744,578.00
297	600566	济川药业	2023年7月4日-2023年7月11日	29.04	59,900	1,739,496.00
298	688116	天奈科技	2023年7月4日-2023年7月11日	45.75	37,900	1,733,925.00
299	000155	川能动力	2023年7月4日-2023年7月11日	14.4	120,400	1,733,760.00
300	688538	和辉光电	2023年7月4日-2023年7月11日	2.54	679,200	1,725,168.00
301	603267	鸿远电子	2023年7月4日-2023年7月11日	65.3	26,400	1,723,920.00
302	600208	新湖中宝	2023年7月4日-2023年7月11日	2.48	693,500	1,719,880.00
303	300357	我武生物	2023年7月4日-2023年7月11日	33.63	51,100	1,718,493.00
304	600985	淮北矿业	2023年7月4日-2023年7月11日	11.52	148,500	1,710,720.00
305	601666	平煤股份	2023年7月4日-2023年7月11日	7.54	226,600	1,708,564.00
306	000739	普洛药业	2023年7月4日-2023年7月11日	17.74	96,200	1,706,588.00
307	601000	唐山港	2023年7月4日-2023年7月11日	3.53	482,900	1,704,637.00
308	603233	大参林	2023年7月4日-2023年7月11日	28.01	60,500	1,694,605.00
309	600282	南钢股份	2023年7月4日-2023年7月11日	3.37	502,100	1,692,077.00
310	000887	中鼎股份	2023年7月4日-2023年7月11日	13.09	128,700	1,684,683.00
311	600755	厦门国贸	2023年7月4日-2023年7月11日	7.74	217,200	1,681,128.00
312	600171	上海贝岭	2023年7月4日-2023年7月11日	18.25	91,800	1,675,350.00
313	600378	昊华科技	2023年7月4日-2023年7月11日	37.64	44,500	1,674,980.00
314	002155	湖南黄金	2023年7月4日-2023年7月11日	12.2	136,900	1,670,180.00
315	002670	国盛金控	2023年7月4日-2023年7月11日	8.78	189,200	1,661,176.00
316	300677	英科医	2023年7月4日-2023年	22	75,300	1,656,600

		疗	7月11日			.00
317	600959	江苏有线	2023年7月4日-2023年7月11日	3.38	488,900	1,652,482.00
318	600316	洪都航空	2023年7月4日-2023年7月11日	23.45	69,800	1,636,810.00
319	002153	石基信息	2023年7月4日-2023年7月11日	14	116,810	1,635,340.00
320	300115	长盈精密	2023年7月4日-2023年7月11日	11.91	136,900	1,630,479.00
321	601231	环旭电子	2023年7月4日-2023年7月11日	14.96	107,800	1,612,688.00
322	600315	上海家化	2023年7月4日-2023年7月11日	29.01	55,500	1,610,055.00
323	300888	稳健医疗	2023年7月4日-2023年7月11日	41.67	38,500	1,604,295.00
324	603218	日月股份	2023年7月4日-2023年7月11日	18.99	84,100	1,597,059.00
325	002030	达安基因	2023年7月4日-2023年7月11日	9.97	160,000	1,595,200.00
326	002487	大金重工	2023年7月4日-2023年7月11日	30.84	51,700	1,594,428.00
327	601866	中远海发	2023年7月4日-2023年7月11日	2.47	645,100	1,593,397.00
328	600517	国网英大	2023年7月4日-2023年7月11日	5.7	279,400	1,592,580.00
329	000778	新兴铸管	2023年7月4日-2023年7月11日	4.08	389,900	1,590,792.00
330	600131	国网信通	2023年7月4日-2023年7月11日	20.19	78,600	1,586,934.00
331	000598	兴蓉环境	2023年7月4日-2023年7月11日	5.43	292,000	1,585,560.00
332	600056	中国医药	2023年7月4日-2023年7月11日	12.98	122,100	1,584,858.00
333	688082	盛美上海	2023年7月4日-2023年7月11日	110.4	14,300	1,578,720.00
334	300363	博腾股份	2023年7月4日-2023年7月11日	29.59	53,300	1,577,147.00
335	603026	胜华新材	2023年7月4日-2023年7月11日	59.25	26,400	1,564,200.00
336	000987	越秀资本	2023年7月4日-2023年7月11日	6.35	245,300	1,557,655.00
337	002221	东华能源	2023年7月4日-2023年7月11日	8.65	179,800	1,555,270.00
338	300251	光线传	2023年7月4日-2023年	8.09	191,400	1,548,426

		煤	7月11日			.00
339	600598	北大荒	2023年7月4日-2023年7月11日	13.33	116,000	1,546,280.00
340	000027	深圳能源	2023年7月4日-2023年7月11日	6.59	232,600	1,532,834.00
341	002326	永太科技	2023年7月4日-2023年7月11日	15.29	100,100	1,530,529.00
342	601005	重庆钢铁	2023年7月4日-2023年7月11日	1.4	1,092,300	1,529,220.00
343	002249	大洋电机	2023年7月4日-2023年7月11日	5.7	267,800	1,526,460.00
344	600906	财达证券	2023年7月4日-2023年7月11日	7.2	211,700	1,524,240.00
345	000709	河钢股份	2023年7月4日-2023年7月11日	2.26	673,700	1,522,562.00
346	002518	科士达	2023年7月4日-2023年7月11日	40.01	37,900	1,516,379.00
347	600582	天地科技	2023年7月4日-2023年7月11日	5.83	259,600	1,513,468.00
348	002183	怡亚通	2023年7月4日-2023年7月11日	5.1	296,400	1,511,640.00
349	601106	中国一重	2023年7月4日-2023年7月11日	3.36	447,100	1,502,256.00
350	002690	美亚光电	2023年7月4日-2023年7月11日	25.75	57,700	1,485,775.00
351	601992	金隅集团	2023年7月4日-2023年7月11日	2.18	679,200	1,480,656.00
352	600718	东软集团	2023年7月4日-2023年7月11日	10.66	138,600	1,477,476.00
353	600373	中文传媒	2023年7月4日-2023年7月11日	13.32	110,500	1,471,860.00
354	000883	湖北能源	2023年7月4日-2023年7月11日	4.56	321,200	1,464,672.00
355	601665	齐鲁银行	2023年7月4日-2023年7月11日	3.92	373,400	1,463,728.00
356	002831	裕同科技	2023年7月4日-2023年7月11日	24.39	59,900	1,460,961.00
357	603568	伟明环保	2023年7月4日-2023年7月11日	17.51	83,000	1,453,330.00
358	002511	中顺洁柔	2023年7月4日-2023年7月11日	11.15	130,300	1,452,845.00
359	000825	太钢不锈	2023年7月4日-2023年7月11日	3.87	373,400	1,445,058.00
360	601778	晶科科技	2023年7月4日-2023年7月11日	4.94	290,900	1,437,046.00

		技	7月11日			.00
361	002985	北摩高科	2023年7月4日-2023年7月11日	44.12	32,400	1,429,488.00
362	603883	老百姓	2023年7月4日-2023年7月11日	29.85	47,800	1,426,830.00
363	601928	凤凰传媒	2023年7月4日-2023年7月11日	11.4	124,300	1,417,020.00
364	600663	陆家嘴	2023年7月4日-2023年7月11日	9.87	143,500	1,416,345.00
365	603228	景旺电子	2023年7月4日-2023年7月11日	25.65	55,000	1,410,750.00
366	600737	中粮糖业	2023年7月4日-2023年7月11日	8.05	174,300	1,403,115.00
367	600967	内蒙一机	2023年7月4日-2023年7月11日	10.1	138,600	1,399,860.00
368	603225	新凤鸣	2023年7月4日-2023年7月11日	11.05	124,800	1,379,040.00
369	600155	华创云信	2023年7月4日-2023年7月11日	6.22	221,100	1,375,242.00
370	600297	广汇汽车	2023年7月4日-2023年7月11日	2.08	661,100	1,375,088.00
371	600801	华新水泥	2023年7月4日-2023年7月11日	12.35	111,100	1,372,085.00
372	688778	厦钨新能	2023年7月4日-2023年7月11日	49.5	27,500	1,361,250.00
373	601098	中南传媒	2023年7月4日-2023年7月11日	11.6	117,100	1,358,360.00
374	300861	美畅股份	2023年7月4日-2023年7月11日	43.37	31,300	1,357,481.00
375	002791	坚朗五金	2023年7月4日-2023年7月11日	64.71	20,900	1,352,439.00
376	002468	申通快递	2023年7月4日-2023年7月11日	10.82	124,800	1,350,336.00
377	300482	万孚生物	2023年7月4日-2023年7月11日	26.63	50,600	1,347,478.00
378	688281	华秦科技	2023年7月4日-2023年7月11日	202.5	6,600	1,336,500.00
379	002745	木林森	2023年7月4日-2023年7月11日	9.2	145,200	1,335,840.00
380	000012	南玻A	2023年7月4日-2023年7月11日	5.96	223,800	1,333,848.00
381	688208	道通科技	2023年7月4日-2023年7月11日	30.31	44,000	1,333,640.00
382	002032	苏泊	2023年7月4日-2023年	50	26,400	1,320,000.00

		尔	7月11日			.00
383	603866	桃李面包	2023年7月4日-2023年7月11日	10.12	130,300	1,318,636.00
384	000156	华数传媒	2023年7月4日-2023年7月11日	8.7	151,200	1,315,440.00
385	600871	石化油服	2023年7月4日-2023年7月11日	1.98	663,300	1,313,334.00
386	600500	中化国际	2023年7月4日-2023年7月11日	5.56	234,300	1,302,708.00
387	000581	威孚高科	2023年7月4日-2023年7月11日	15.75	81,900	1,289,925.00
388	688690	纳微科技	2023年7月4日-2023年7月11日	38.85	33,000	1,282,050.00
389	000401	冀东水泥	2023年7月4日-2023年7月11日	7.37	173,200	1,276,484.00
390	002867	周大生	2023年7月4日-2023年7月11日	17.78	71,500	1,271,270.00
391	688276	百克生物	2023年7月4日-2023年7月11日	62.6	20,300	1,270,780.00
392	002250	联化科技	2023年7月4日-2023年7月11日	10.46	120,400	1,259,384.00
393	688029	南微医学	2023年7月4日-2023年7月11日	81.56	15,400	1,256,024.00
394	600556	天下秀	2023年7月4日-2023年7月11日	7.09	176,500	1,251,385.00
395	301029	怡合达	2023年7月4日-2023年7月11日	44.68	28,000	1,251,040.00
396	601118	海南橡胶	2023年7月4日-2023年7月11日	4.48	278,800	1,249,024.00
397	688520	神州细胞	2023年7月4日-2023年7月11日	56.74	22,000	1,248,280.00
398	601611	中国核建	2023年7月4日-2023年7月11日	8.45	147,400	1,245,530.00
399	600022	山东钢铁	2023年7月4日-2023年7月11日	1.42	871,700	1,237,814.00
400	000930	中粮科技	2023年7月4日-2023年7月11日	8.1	151,800	1,229,580.00
401	002010	传化智联	2023年7月4日-2023年7月11日	5.32	228,200	1,214,024.00
402	300850	新强联	2023年7月4日-2023年7月11日	37.38	32,400	1,211,112.00
403	688006	杭可科技	2023年7月4日-2023年7月11日	30.47	39,600	1,206,612.00
404	601598	中国外	2023年7月4日-2023年	4.66	256,800	1,196,688

		运	7月11日			.00
405	600259	广晟有色	2023年7月4日-2023年7月11日	36.14	33,000	1,192,620.00
406	601608	中信重工	2023年7月4日-2023年7月11日	4.21	282,700	1,190,167.00
407	600062	华润双鹤	2023年7月4日-2023年7月11日	17.42	68,200	1,188,044.00
408	002505	鹏都农牧	2023年7月4日-2023年7月11日	1.89	623,100	1,177,659.00
409	000559	万向钱潮	2023年7月4日-2023年7月11日	5.45	215,600	1,175,020.00
410	002081	金螳螂	2023年7月4日-2023年7月11日	4.51	259,600	1,170,796.00
411	600597	光明乳业	2023年7月4日-2023年7月11日	10.4	112,200	1,166,880.00
412	000089	深圳机场	2023年7月4日-2023年7月11日	6.95	167,200	1,162,040.00
413	600782	新钢股份	2023年7月4日-2023年7月11日	3.71	311,800	1,156,778.00
414	603826	坤彩科技	2023年7月4日-2023年7月11日	50	23,100	1,155,000.00
415	300618	寒锐钴业	2023年7月4日-2023年7月11日	32.41	35,200	1,140,832.00
416	000958	电投产融	2023年7月4日-2023年7月11日	4.33	263,400	1,140,522.00
417	300776	帝尔激光	2023年7月4日-2023年7月11日	64.9	17,420	1,130,558.00
418	603638	艾迪精密	2023年7月4日-2023年7月11日	20.52	55,000	1,128,600.00
419	600901	江苏金租	2023年7月4日-2023年7月11日	4.13	272,580	1,125,755.40
420	688052	纳芯微	2023年7月4日-2023年7月11日	158.37	7,100	1,124,427.00
421	600707	彩虹股份	2023年7月4日-2023年7月11日	4.76	233,700	1,112,412.00
422	600339	中油工程	2023年7月4日-2023年7月11日	4.07	272,800	1,110,296.00
423	000937	冀中能源	2023年7月4日-2023年7月11日	6.38	172,700	1,101,826.00
424	600409	三友化工	2023年7月4日-2023年7月11日	5.45	201,800	1,099,810.00
425	688107	安路科技	2023年7月4日-2023年7月11日	55.39	19,800	1,096,722.00
426	600095	湘财股	2023年7月4日-2023年	7.8	139,700	1,089,660

		份	7月11日			.00
427	000898	鞍钢股份	2023年7月4日-2023年7月11日	2.78	390,500	1,085,590.00
428	603707	健友股份	2023年7月4日-2023年7月11日	13.5	79,200	1,069,200.00
429	002761	浙江建投	2023年7月4日-2023年7月11日	15.18	70,400	1,068,672.00
430	000537	广宇发展	2023年7月4日-2023年7月11日	11.67	91,300	1,065,471.00
431	601718	际华集团	2023年7月4日-2023年7月11日	2.97	358,000	1,063,260.00
432	000415	渤海租赁	2023年7月4日-2023年7月11日	2.1	503,800	1,057,980.00
433	600507	方大特钢	2023年7月4日-2023年7月11日	4.63	228,200	1,056,566.00
434	000967	盈峰环境	2023年7月4日-2023年7月11日	5.05	207,300	1,046,865.00
435	001914	招商积余	2023年7月4日-2023年7月11日	15.05	69,300	1,042,965.00
436	600167	联美控股	2023年7月4日-2023年7月11日	6.97	149,000	1,038,530.00
437	601568	北元集团	2023年7月4日-2023年7月11日	5.27	194,100	1,022,907.00
438	600968	海油发展	2023年7月4日-2023年7月11日	3.07	331,100	1,016,477.00
439	688234	天岳先进	2023年7月4日-2023年7月11日	73.94	13,700	1,012,978.00
440	600808	马钢股份	2023年7月4日-2023年7月11日	2.57	393,200	1,010,524.00
441	601156	东航物流	2023年7月4日-2023年7月11日	13	77,500	1,007,500.00
442	000563	陕国投A	2023年7月4日-2023年7月11日	3.05	330,000	1,006,500.00
443	002925	盈趣科技	2023年7月4日-2023年7月11日	19.4	51,100	991,340.00
444	300257	开山股份	2023年7月4日-2023年7月11日	15.17	64,900	984,533.00
445	600195	中牧股份	2023年7月4日-2023年7月11日	11.68	83,000	969,440.00
446	600126	杭钢股份	2023年7月4日-2023年7月11日	4.34	220,000	954,800.00
447	603650	彤程新材	2023年7月4日-2023年7月11日	32.8	29,100	954,480.00
448	002705	新宝股	2023年7月4日-2023年	18.03	52,800	951,984.00



		份	7月11日			0
449	600764	中国海防	2023年7月4日-2023年7月11日	27.22	34,600	941,812.00
450	002958	青农商行	2023年7月11日	2.72	345,600	940,032.00
451	603379	三美股份	2023年7月4日-2023年7月11日	23.51	39,600	930,996.00
452	688185	康希诺	2023年7月4日-2023年7月11日	81.5	11,000	896,500.00
453	000959	首钢股份	2023年7月4日-2023年7月11日	3.5	254,600	891,100.00
454	000402	金融街	2023年7月4日-2023年7月11日	4.52	194,700	880,044.00
455	002653	海思科	2023年7月4日-2023年7月11日	23.6	36,300	856,680.00
456	601828	美凯龙	2023年7月4日-2023年7月11日	4.79	176,500	845,435.00
457	002110	三钢闽光	2023年7月4日-2023年7月11日	4.22	199,600	842,312.00
458	002563	森马服饰	2023年7月4日-2023年7月11日	6.22	131,400	817,308.00
459	688819	天能股份	2023年7月4日-2023年7月11日	36.84	22,000	810,480.00
460	688289	圣湘生物	2023年7月4日-2023年7月11日	16.84	47,800	804,952.00
461	601298	青岛港	2023年7月4日-2023年7月11日	6.97	114,400	797,368.00
462	600377	宁沪高速	2023年7月4日-2023年7月11日	9.83	80,800	794,264.00
463	601228	广州港	2023年7月4日-2023年7月11日	3.23	245,800	793,934.00
464	603056	德邦股份	2023年7月4日-2023年7月11日	15.42	50,000	771,000.00
465	600623	华谊集团	2023年7月4日-2023年7月11日	6.23	123,200	767,536.00
466	000031	大悦城	2023年7月4日-2023年7月11日	3.66	209,500	766,770.00
467	600928	西安银行	2023年7月4日-2023年7月11日	3.52	217,200	764,544.00
468	603317	天味食品	2023年7月4日-2023年7月11日	14.61	52,200	762,642.00
469	603529	爱玛科技	2023年7月11日	32.22	23,100	744,282.00
470	601869	长飞光	2023年7月4日-2023年	37.01	19,800	732,798.00

		纤	7月11日			0
471	600350	山东高速	2023年7月4日-2023年7月11日	6.37	110,000	700,700.00
472	002399	海普瑞	2023年7月4日-2023年7月11日	11.47	61,000	699,670.00
473	000869	张裕A	2023年7月4日-2023年7月11日	30.66	22,000	674,520.00
474	601139	深圳燃气	2023年7月4日-2023年7月11日	7.29	91,800	669,222.00
475	601969	海南矿业	2023年7月4日-2023年7月11日	6.58	99,500	654,710.00
476	001872	招商港口	2023年7月4日-2023年7月11日	17.27	37,900	654,533.00
477	600995	南网储能	2023年7月4日-2023年7月11日	11.01	57,200	629,772.00
478	688105	诺唯赞	2023年7月4日-2023年7月11日	30.49	19,800	603,702.00
479	002945	华林证券	2023年7月4日-2023年7月11日	13.68	44,000	601,920.00
480	000553	安道麦A	2023年7月4日-2023年7月11日	8.44	70,900	598,396.00
481	002608	江苏国信	2023年7月4日-2023年7月11日	7.57	78,400	593,488.00
482	688248	南网科技	2023年7月4日-2023年7月11日	38.39	13,700	525,943.00
483	600299	安迪苏	2023年7月4日-2023年7月11日	7.97	65,400	521,238.00
484	601158	重庆水务	2023年7月4日-2023年7月11日	5.56	89,100	495,396.00
485	603868	飞科电器	2023年7月4日-2023年7月11日	63.09	7,700	485,793.00
486	688295	中复神鹰	2023年7月4日-2023年7月11日	36.68	13,200	484,176.00
487	603355	莱克电气	2023年7月4日-2023年7月11日	25.41	18,700	475,167.00
488	600032	浙江新能	2023年7月4日-2023年7月11日	12.56	35,200	442,112.00
489	300741	华宝股份	2023年7月4日-2023年7月11日	21.42	20,300	434,826.00
490	600956	新天绿能	2023年7月4日-2023年7月11日	8.72	49,500	431,640.00
491	002901	大博医疗	2023年7月4日-2023年7月11日	31.08	9,300	289,044.00
合计	-	-	-	-	106,647,26	1,091,784

					1	, 551.98
--	--	--	--	--	---	----------

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。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，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。

### 6.4.13.2 信用风险

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

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。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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同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。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金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

6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	73,745,343.85	-	-	-	73,745,343.85
结算备付金	28,162,076.80	-	-	-	28,162,076.80
存出保证金	1,177,734.74	-	-	8,626,752.00	9,804,486.74
交易性金融资产	-	-	-	6,336,316,048.41	6,336,316,048.41
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	271,355.27	271,355.27
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	2,958,198.07	2,958,198.07
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	309,104.73	309,104.73

资产总计	103,085,155.39	-	-	-6,348,481,458.48	6,451,566,613.87
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	-	-	-	30,741,463.92	30,741,463.92
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	726,779.55	726,779.55
应付托管费	-	-	-	242,259.88	242,259.88
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	23,886.71	23,886.71
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	2,099,992.14	2,099,992.14
负债总计	-	-	-	33,834,382.20	33,834,382.20
利率敏感度缺口	103,085,155.39	-	-	-6,314,647,076.28	6,417,732,231.67
上年度末 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

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
分析	市场利率上升 25 个基点	-	-
	市场利率下降 25 个基点	-	-

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

##### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

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（2023年6月30日）	上年度末（2022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%		
--	-------	--	--

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。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。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022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	6,336,316,048.41	98.73	8,174,750,196.18	99.02
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	6,336,316,048.41	98.73	8,174,750,196.18	99.02

##### 6.4.13.4.3.2 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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）	
分析	业绩比较基准上升5%	319,962,737.30	412,659,024.28
	业绩比较基准下降	-319,962,737.30	-412,659,024.28



	5%		
--	----	--	--

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	6,328,576,028.03	8,143,578,347.51
第二层次	6,182,352.18	30,084,340.41
第三层次	1,557,668.20	1,087,508.26
合计	6,336,316,048.41	8,174,750,196.18

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于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。

###### 6.4.14.3 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）。

###### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括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。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	6,336,316,048.41	98.21
	其中：股票	6,336,316,048.41	98.21
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	101,907,420.65	1.58
8	其他各项资产	13,343,144.81	0.21
9	合计	6,451,566,613.87	100.00

注：1. 股票投资的公允价值包含可替代款的估值增值；2. 通过转融通证券出借业务出借的证券公允价值为 1,091,784,551.98 元，占基金资产净值的比例为 17.01%。

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	44,387,310.50	0.69
B	采矿业	233,362,339.70	3.64
C	制造业	3,971,674,105.88	61.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	218,449,200.41	3.40
E	建筑业	70,435,577.68	1.10
F	批发和零售业	200,074,244.62	3.12
G	交通运输、仓储和邮政业	95,411,349.79	1.49
H	住宿和餐饮业	11,859,478.50	0.18
I	信息传输、软件和	520,108,176.82	8.10

	信息技术服务业		
J	金融业	542,630,719.37	8.46
K	房地产业	85,902,477.28	1.34
L	租赁和商务服务业	77,721,020.08	1.21
M	科学研究和技术服务业	71,291,747.45	1.11
N	水利、环境和公共设施管理业	35,247,710.05	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	31,718,006.93	0.49
R	文化、体育和娱乐业	89,517,984.00	1.39
S	综合	33,349,270.93	0.52
	合计	6,333,140,719.99	98.68

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,663,421.16	0.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	8,140.64	0.00
F	批发和零售业	83,928.25	0.00
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	119,783.56	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,218,690.00	0.02
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	14,394.48	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	7,740.00	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	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐	-	-

	业		
S	综合	-	-
	合计	3,175,328.42	0.05

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	598,741	88,284,360.45	1.38
2	688256	寒武纪	194,201	36,509,788.00	0.57
3	000988	华工科技	937,422	35,631,410.22	0.56
4	002340	格林美	4,788,000	33,085,080.00	0.52
5	002384	东山精密	1,275,244	33,028,819.60	0.51
6	002422	科伦药业	1,097,900	32,585,672.00	0.51
7	600372	中航电子	2,090,693	31,736,719.74	0.49
8	300418	昆仑万维	780,211	31,426,899.08	0.49
9	300012	华测检测	1,568,900	30,593,550.00	0.48
10	600157	永泰能源	20,714,100	29,414,022.00	0.46
11	300724	捷佳伟创	259,700	29,177,295.00	0.45
12	600079	人福医药	1,065,500	28,704,570.00	0.45
13	600489	中金黄金	2,711,500	28,009,795.00	0.44
14	300003	乐普医疗	1,227,240	27,747,896.40	0.43
15	688777	中控技术	439,767	27,608,572.26	0.43
16	002738	中矿资源	531,924	27,096,208.56	0.42
17	600487	亨通光电	1,839,800	26,971,468.00	0.42
18	002028	思源电气	571,350	26,693,472.00	0.42
19	600536	中国软件	561,325	26,314,916.00	0.41
20	002463	沪电股份	1,243,200	26,032,608.00	0.41
21	601058	赛轮轮胎	2,284,200	26,017,038.00	0.41
22	601555	东吴证券	3,734,870	25,919,997.80	0.40
23	600765	中航重机	960,610	25,465,771.10	0.40
24	300037	新宙邦	486,642	25,251,853.38	0.39
25	000066	中国长城	1,804,400	24,954,852.00	0.39
26	600885	宏发股份	777,670	24,768,789.50	0.39
27	000807	云铝股份	1,939,867	24,694,506.91	0.38
28	600482	中国动力	1,007,200	23,608,768.00	0.37
29	000009	中国宝安	1,923,717	23,219,264.19	0.36
30	688099	晶晨股份	272,627	22,987,908.64	0.36
31	000423	东阿阿胶	427,000	22,823,150.00	0.36

32	300146	汤臣倍健	951,148	22,808,529.04	0.36
33	600352	浙江龙盛	2,426,500	22,687,775.00	0.35
34	300058	蓝色光标	2,322,382	22,457,433.94	0.35
35	002966	苏州银行	3,418,542	22,391,450.10	0.35
36	002156	通富微电	987,490	22,317,274.00	0.35
37	002185	华天科技	2,390,062	21,988,570.40	0.34
38	601108	财通证券	3,030,600	21,941,544.00	0.34
39	600415	小商品城	2,557,400	21,814,622.00	0.34
40	002625	光启技术	1,406,140	21,457,696.40	0.33
41	002624	完美世界	1,266,000	21,382,740.00	0.33
42	600027	华电国际	3,173,700	21,232,053.00	0.33
43	300144	宋城演艺	1,706,400	21,159,360.00	0.33
44	600109	国金证券	2,430,600	21,073,302.00	0.33
45	000783	长江证券	3,609,000	20,932,200.00	0.33
46	600988	赤峰黄金	1,551,300	20,880,498.00	0.33
47	600161	天坛生物	768,100	20,853,915.00	0.32
48	601233	桐昆股份	1,573,500	20,848,875.00	0.32
49	601077	渝农商行	5,772,200	20,722,198.00	0.32
50	002008	大族激光	784,700	20,559,140.00	0.32
51	300568	星源材质	1,194,900	20,540,331.00	0.32
52	600298	安琪酵母	566,961	20,529,657.81	0.32
53	300285	国瓷材料	748,636	20,512,626.40	0.32
54	600418	江淮汽车	1,628,886	20,507,674.74	0.32
55	600096	云天化	1,197,100	20,434,497.00	0.32
56	002385	大北农	3,086,248	20,369,236.80	0.32
57	002223	鱼跃医疗	560,760	20,181,752.40	0.31
58	000630	铜陵有色	6,869,900	19,854,011.00	0.31
59	002407	多氟多	998,629	19,832,771.94	0.31
60	603444	吉比特	40,279	19,781,419.69	0.31
61	603882	金域医学	261,400	19,735,700.00	0.31
62	600862	中航高科	779,300	19,724,083.00	0.31
63	300390	天华新能	546,550	19,566,490.00	0.30
64	002409	雅克科技	266,200	19,400,656.00	0.30
65	300024	机器人	1,156,333	19,276,071.11	0.30
66	601162	天风证券	6,463,400	19,260,932.00	0.30
67	603688	石英股份	168,756	19,211,183.04	0.30
68	002497	雅化集团	1,074,480	19,104,254.40	0.30
69	300474	景嘉微	212,220	19,097,677.80	0.30
70	000933	神火股份	1,469,000	19,097,000.00	0.30
71	300073	当升科技	377,772	19,013,264.76	0.30
72	002240	盛新锂能	595,100	18,965,837.00	0.30
73	300395	菲利华	385,250	18,954,300.00	0.30
74	600705	中航产融	4,939,800	18,919,434.00	0.29

75	300604	长川科技	396,700	18,839,283.00	0.29
76	601168	西部矿业	1,777,342	18,679,864.42	0.29
77	605358	立昂微	504,740	18,539,100.20	0.29
78	002439	启明星辰	621,600	18,498,816.00	0.29
79	000932	华菱钢铁	3,864,641	18,434,337.57	0.29
80	600066	宇通客车	1,238,400	18,254,016.00	0.28
81	603596	伯特利	230,300	18,253,578.00	0.28
82	000975	银泰黄金	1,553,222	18,172,697.40	0.28
83	002600	领益智造	2,624,900	18,138,059.00	0.28
84	300136	信维通信	902,251	18,117,200.08	0.28
85	600060	海信视像	731,456	18,103,536.00	0.28
86	002138	顺络电子	751,714	17,973,481.74	0.28
87	002797	第一创业	3,134,400	17,928,768.00	0.28
88	002568	百润股份	489,496	17,793,179.60	0.28
89	002465	海格通信	1,718,700	17,771,358.00	0.28
90	603816	顾家家居	459,800	17,541,370.00	0.27
91	000021	深科技	872,892	17,449,111.08	0.27
92	601128	常熟银行	2,555,393	17,427,780.26	0.27
93	603939	益丰药房	470,942	17,424,854.00	0.27
94	002850	科达利	131,668	17,413,093.00	0.27
95	600839	四川长虹	3,443,000	17,387,150.00	0.27
96	600563	法拉电子	126,331	17,345,246.30	0.27
97	600160	巨化股份	1,258,427	17,341,124.06	0.27
98	300253	卫宁健康	1,601,898	17,332,536.36	0.27
99	000591	太阳能	2,551,200	17,297,136.00	0.27
100	300832	新产业	292,996	17,286,764.00	0.27
101	600879	航天电子	2,028,184	17,219,282.16	0.27
102	688567	孚能科技	794,690	17,157,357.10	0.27
103	600873	梅花生物	1,920,900	17,153,637.00	0.27
104	000683	远兴能源	2,363,600	16,994,284.00	0.26
105	601990	南京证券	2,062,045	16,867,528.10	0.26
106	600392	盛和资源	1,307,270	16,824,564.90	0.26
107	688521	芯原股份	233,913	16,823,022.96	0.26
108	688169	石头科技	52,411	16,807,159.48	0.26
109	002368	太极股份	406,995	16,755,984.15	0.26
110	300699	光威复材	542,514	16,736,556.90	0.26
111	002078	太阳纸业	1,563,307	16,711,751.83	0.26
112	600497	驰宏锌锗	3,322,700	16,679,954.00	0.26
113	300866	安克创新	189,600	16,590,000.00	0.26
114	601696	中银证券	1,554,000	16,565,640.00	0.26
115	603589	口子窖	335,574	16,560,576.90	0.26
116	000729	燕京啤酒	1,313,830	16,383,460.10	0.26
117	300118	东方日升	638,000	16,351,940.00	0.25

118	600177	雅戈尔	2,589,300	16,338,483.00	0.25
119	002025	航天电器	255,500	16,300,900.00	0.25
120	600516	方大炭素	2,627,400	16,289,880.00	0.25
121	000831	中国稀土	548,700	16,241,520.00	0.25
122	002294	信立泰	519,627	16,207,166.13	0.25
123	300017	网宿科技	2,272,200	16,155,342.00	0.25
124	600141	兴发集团	725,441	16,119,299.02	0.25
125	688390	固德威	96,485	16,099,487.10	0.25
126	600642	申能股份	2,288,500	15,996,615.00	0.25
127	000728	国元证券	2,441,000	15,915,320.00	0.25
128	002673	西部证券	2,500,200	15,876,270.00	0.25
129	002430	杭氧股份	458,984	15,770,690.24	0.25
130	600699	均胜电子	893,100	15,754,284.00	0.25
131	000629	钒钛股份	4,010,072	15,679,381.52	0.24
132	600170	上海建工	5,799,170	15,599,767.30	0.24
133	002532	天山铝业	2,602,200	15,587,178.00	0.24
134	600325	华发股份	1,579,077	15,553,908.45	0.24
135	600118	中国卫星	551,188	15,549,013.48	0.24
136	002273	水晶光电	1,296,490	15,480,090.60	0.24
137	002195	二三四五	5,337,378	15,425,022.42	0.24
138	002268	电科网安	551,955	15,382,985.85	0.24
139	601966	玲珑轮胎	688,400	15,296,248.00	0.24
140	002739	万达电影	1,219,100	15,287,514.00	0.24
141	600153	建发股份	1,400,800	15,282,728.00	0.24
142	600521	华海药业	829,300	15,267,413.00	0.24
143	002372	伟星新材	742,156	15,243,884.24	0.24
144	600166	福田汽车	4,477,200	15,222,480.00	0.24
145	600486	扬农化工	173,614	15,177,335.88	0.24
146	000400	许继电气	658,285	15,173,469.25	0.24
147	600143	金发科技	1,734,100	15,138,693.00	0.24
148	300595	欧普康视	500,549	15,111,574.31	0.24
149	600549	厦门钨业	793,380	15,098,021.40	0.24
150	688072	拓荆科技	35,396	15,077,634.12	0.23
151	000998	隆平高科	982,197	15,076,723.95	0.23
152	603000	人民网	515,400	15,049,680.00	0.23
153	600399	抚顺特钢	1,470,900	15,003,180.00	0.23
154	000738	航发控制	613,000	14,957,200.00	0.23
155	688002	睿创微纳	333,623	14,946,310.40	0.23
156	600637	东方明珠	1,910,000	14,936,200.00	0.23
157	688220	翱捷科技	196,405	14,806,972.95	0.23
158	689009	九号公司	401,140	14,782,009.00	0.23
159	002065	东华软件	2,091,900	14,768,814.00	0.23
160	002444	巨星科技	672,784	14,720,513.92	0.23

161	600859	王府井	740,700	14,658,453.00	0.23
162	688536	思瑞浦	67,237	14,657,666.00	0.23
163	600481	双良节能	1,046,427	14,629,049.46	0.23
164	300487	蓝晓科技	234,250	14,621,885.00	0.23
165	000997	新大陆	769,774	14,548,728.60	0.23
166	601577	长沙银行	1,874,600	14,546,896.00	0.23
167	601198	东兴证券	1,808,200	14,501,764.00	0.23
168	002131	利欧股份	6,297,579	14,484,431.70	0.23
169	300438	鹏辉能源	301,043	14,462,105.72	0.23
170	600499	科达制造	1,271,591	14,445,273.76	0.23
171	002353	杰瑞股份	574,436	14,435,576.68	0.22
172	300383	光环新网	1,340,719	14,412,729.25	0.22
173	600704	物产中大	2,905,900	14,355,146.00	0.22
174	000960	锡业股份	920,693	14,316,776.15	0.22
175	300682	朗新科技	613,500	14,282,280.00	0.22
176	600271	航天信息	1,036,400	14,188,316.00	0.22
177	600021	上海电力	1,313,000	14,141,010.00	0.22
178	300001	特锐德	679,326	14,116,394.28	0.22
179	000519	中兵红箭	778,929	14,090,825.61	0.22
180	601997	贵阳银行	2,727,000	14,071,320.00	0.22
181	002373	千方科技	1,031,272	14,066,550.08	0.22
182	603077	和邦生物	5,763,448	14,005,178.64	0.22
183	688009	中国通号	2,411,279	13,985,418.20	0.22
184	000623	吉林敖东	867,488	13,914,507.52	0.22
185	000703	恒逸石化	2,050,810	13,904,491.80	0.22
186	300676	华大基因	231,500	13,887,685.00	0.22
187	002056	横店东磁	758,216	13,807,113.36	0.22
188	300088	长信科技	2,288,759	13,801,216.77	0.22
189	002507	涪陵榨菜	753,020	13,787,796.20	0.21
190	600380	健康元	1,079,123	13,715,653.33	0.21
191	600511	国药股份	351,709	13,663,894.65	0.21
192	000513	丽珠集团	349,635	13,604,297.85	0.21
193	688516	奥特维	72,175	13,597,770.00	0.21
194	600867	通化东宝	1,301,100	13,583,484.00	0.21
195	002152	广电运通	1,157,735	13,568,654.20	0.21
196	002281	光迅科技	364,923	13,534,994.07	0.21
197	600498	烽火通信	663,900	13,523,643.00	0.21
198	600998	九州通	1,301,535	13,509,933.30	0.21
199	600529	山东药玻	494,885	13,470,769.70	0.21
200	688301	奕瑞科技	47,440	13,398,479.20	0.21
201	600546	山煤国际	924,200	13,373,174.00	0.21
202	002203	海亮股份	1,111,194	13,345,439.94	0.21
203	002299	圣农发展	695,657	13,321,831.55	0.21



204	600348	华阳股份	1,681,600	13,301,456.00	0.21
205	601016	节能风电	3,621,985	13,292,684.95	0.21
206	000636	风华高科	862,877	13,236,533.18	0.21
207	603338	浙江鼎力	236,000	13,218,360.00	0.21
208	600739	辽宁成大	998,300	13,127,645.00	0.20
209	603517	绝味食品	353,040	13,115,436.00	0.20
210	002595	豪迈科技	372,885	13,099,450.05	0.20
211	603712	七一二	432,000	13,050,720.00	0.20
212	002192	融捷股份	193,800	12,951,654.00	0.20
213	601636	旗滨集团	1,501,100	12,939,482.00	0.20
214	603737	三棵树	196,642	12,864,319.64	0.20
215	002080	中材科技	625,800	12,841,416.00	0.20
216	603927	中科软	332,015	12,802,498.40	0.20
217	002531	天顺风能	840,200	12,796,246.00	0.20
218	002506	协鑫集成	4,363,483	12,785,005.19	0.20
219	603885	吉祥航空	825,600	12,739,008.00	0.20
220	002432	九安医疗	361,400	12,724,894.00	0.20
221	688772	珠海冠宇	627,561	12,645,354.15	0.20
222	600863	内蒙华电	3,042,500	12,626,375.00	0.20
223	600970	中材国际	985,377	12,563,556.75	0.20
224	600580	卧龙电驱	857,919	12,534,196.59	0.20
225	688385	复旦微电	249,285	12,489,178.50	0.19
226	600655	豫园股份	1,818,000	12,471,480.00	0.19
227	002092	中泰化学	1,931,742	12,459,735.90	0.19
228	300182	捷成股份	1,966,800	12,410,508.00	0.19
229	000878	云南铜业	1,120,800	12,384,840.00	0.19
230	300212	易华录	372,359	12,373,489.57	0.19
231	002683	广东宏大	418,985	12,334,918.40	0.19
232	600820	隧道股份	2,051,920	12,332,039.20	0.19
233	300296	利亚德	1,886,500	12,318,845.00	0.19
234	600528	中铁工业	1,242,710	12,277,974.80	0.19
235	600909	华安证券	2,627,770	12,271,685.90	0.19
236	002939	长城证券	1,504,500	12,231,585.00	0.19
237	002926	华西证券	1,468,400	12,202,404.00	0.19
238	600535	天士力	838,900	12,172,439.00	0.19
239	300244	迪安诊断	467,511	11,982,306.93	0.19
240	300748	金力永磁	399,500	11,953,040.00	0.19
241	600329	达仁堂	265,809	11,932,166.01	0.19
242	000547	航天发展	1,192,200	11,922,000.00	0.19
243	000893	亚钾国际	519,700	11,921,918.00	0.19
244	000750	国海证券	3,553,191	11,903,189.85	0.19
245	603233	大参林	424,896	11,901,336.96	0.19
246	600258	首旅酒店	625,830	11,859,478.50	0.18

247	603160	汇顶科技	256,200	11,849,250.00	0.18
248	000039	中集集团	1,717,402	11,832,899.78	0.18
249	600008	首创环保	4,106,230	11,825,942.40	0.18
250	600416	湘电股份	617,814	11,794,069.26	0.18
251	002557	洽洽食品	283,612	11,784,078.60	0.18
252	603156	养元饮品	471,860	11,654,942.00	0.18
253	000970	中科三环	906,932	11,626,868.24	0.18
254	002429	兆驰股份	2,110,243	11,606,336.50	0.18
255	000060	中金岭南	2,439,171	11,586,062.25	0.18
256	688200	华峰测控	75,400	11,536,200.00	0.18
257	603456	九洲药业	419,551	11,487,306.38	0.18
258	601991	大唐发电	3,467,100	11,476,101.00	0.18
259	603893	瑞芯微	156,192	11,378,587.20	0.18
260	000830	鲁西化工	1,075,483	11,357,100.48	0.18
261	603658	安图生物	218,700	11,313,351.00	0.18
262	600369	西南证券	3,097,700	11,306,605.00	0.18
263	600390	五矿资本	2,096,800	11,280,784.00	0.18
264	600435	北方导航	977,410	11,230,440.90	0.17
265	300558	贝达药业	233,500	11,215,005.00	0.17
266	002500	山西证券	2,008,014	11,204,718.12	0.17
267	002508	老板电器	442,500	11,190,825.00	0.17
268	600398	海澜之家	1,610,900	11,082,992.00	0.17
269	002128	电投能源	835,907	11,050,690.54	0.17
270	002936	郑州银行	4,794,878	11,028,219.40	0.17
271	601880	辽港股份	7,021,649	10,953,772.44	0.17
272	600038	中直股份	274,761	10,940,983.02	0.17
273	300009	安科生物	1,091,978	10,919,780.00	0.17
274	300070	碧水源	2,027,338	10,866,531.68	0.17
275	601717	郑煤机	860,871	10,717,843.95	0.17
276	002153	石基信息	763,260	10,685,640.00	0.17
277	600848	上海临港	893,000	10,671,350.00	0.17
278	600985	淮北矿业	925,300	10,659,456.00	0.17
279	300026	红日药业	1,960,500	10,625,910.00	0.17
280	603858	步长制药	515,548	10,615,133.32	0.17
281	000050	深天马 A	1,145,684	10,517,379.12	0.16
282	300529	健帆生物	451,916	10,475,412.88	0.16
283	002572	索菲亚	595,364	10,371,240.88	0.16
284	601179	中国西电	1,911,500	10,341,215.00	0.16
285	603127	昭衍新药	252,072	10,309,744.80	0.16
286	688188	柏楚电子	54,438	10,264,829.28	0.16
287	300373	扬杰科技	252,400	10,239,868.00	0.16
288	002244	滨江集团	1,160,370	10,234,463.40	0.16
289	688779	长远锂科	899,556	10,137,996.12	0.16

290	601456	国联证券	1,113,700	10,134,670.00	0.16
291	600673	东阳光	1,404,994	10,130,006.74	0.16
292	002408	齐翔腾达	1,590,183	10,129,465.71	0.16
293	002266	浙富控股	2,444,615	10,096,259.95	0.16
294	601958	金钼股份	902,600	10,063,990.00	0.16
295	003035	南网能源	1,412,600	10,057,712.00	0.16
296	600895	张江高科	721,862	10,048,319.04	0.16
297	002019	亿帆医药	685,860	10,013,556.00	0.16
298	600827	百联股份	747,863	9,998,928.31	0.16
299	600566	济川药业	343,700	9,981,048.00	0.16
300	600667	太极实业	1,374,500	9,978,870.00	0.16
301	688116	天奈科技	218,083	9,977,297.25	0.16
302	603267	鸿远电子	152,050	9,928,865.00	0.15
303	000155	川能动力	688,100	9,908,640.00	0.15
304	688538	和辉光电	3,884,898	9,867,640.92	0.15
305	002958	青农商行	3,625,700	9,861,904.00	0.15
306	300357	我武生物	292,847	9,848,444.61	0.15
307	600208	新湖中宝	3,966,500	9,836,920.00	0.15
308	601666	平煤股份	1,295,100	9,765,054.00	0.15
309	601000	唐山港	2,762,366	9,751,151.98	0.15
310	000739	普洛药业	549,305	9,744,670.70	0.15
311	600171	上海贝岭	530,876	9,688,487.00	0.15
312	600282	南钢股份	2,873,900	9,685,043.00	0.15
313	000887	中鼎股份	736,400	9,639,476.00	0.15
314	600755	厦门国贸	1,242,711	9,618,583.14	0.15
315	600378	昊华科技	254,900	9,594,436.00	0.15
316	002155	湖南黄金	784,417	9,569,887.40	0.15
317	002670	国盛金控	1,082,388	9,503,366.64	0.15
318	300677	英科医疗	430,140	9,463,080.00	0.15
319	600959	江苏有线	2,797,370	9,455,110.60	0.15
320	600316	洪都航空	401,472	9,414,518.40	0.15
321	300115	长盈精密	783,766	9,334,653.06	0.15
322	300888	稳健医疗	221,721	9,239,114.07	0.14
323	601231	环旭电子	617,300	9,234,808.00	0.14
324	600315	上海家化	316,377	9,178,096.77	0.14
325	002487	大金重工	297,200	9,165,648.00	0.14
326	002030	达安基因	915,990	9,132,420.30	0.14
327	603218	日月股份	480,620	9,126,973.80	0.14
328	601866	中远海发	3,691,000	9,116,770.00	0.14
329	600517	国网英大	1,599,400	9,116,580.00	0.14
330	000778	新兴铸管	2,231,975	9,106,458.00	0.14
331	000598	兴蓉环境	1,670,100	9,068,643.00	0.14
332	600131	国网信通	448,500	9,055,215.00	0.14

333	600056	中国医药	697,307	9,051,044.86	0.14
334	300363	博腾股份	305,400	9,036,786.00	0.14
335	600582	天地科技	1,543,400	8,998,022.00	0.14
336	603026	胜华新材	151,094	8,952,319.50	0.14
337	688082	盛美上海	80,843	8,925,067.20	0.14
338	000987	越秀资本	1,403,215	8,910,415.25	0.14
339	002221	东华能源	1,028,555	8,897,000.75	0.14
340	002249	大洋电机	1,555,284	8,865,118.80	0.14
341	300251	光线传媒	1,094,000	8,850,460.00	0.14
342	600598	北大荒	663,100	8,839,123.00	0.14
343	000027	深圳能源	1,330,584	8,768,548.56	0.14
344	601005	重庆钢铁	6,250,600	8,750,840.00	0.14
345	002326	永太科技	572,000	8,745,880.00	0.14
346	600906	财达证券	1,210,100	8,712,720.00	0.14
347	000709	河钢股份	3,855,000	8,712,300.00	0.14
348	002518	科士达	217,300	8,694,173.00	0.14
349	002183	怡亚通	1,695,400	8,646,540.00	0.13
350	601106	中国一重	2,557,400	8,592,864.00	0.13
351	601992	金隅集团	3,887,300	8,474,314.00	0.13
352	002690	美亚光电	329,008	8,471,956.00	0.13
353	002831	裕同科技	346,957	8,462,281.23	0.13
354	600718	东软集团	791,900	8,441,654.00	0.13
355	600373	中文传媒	631,600	8,412,912.00	0.13
356	000883	湖北能源	1,837,300	8,378,088.00	0.13
357	601665	齐鲁银行	2,135,400	8,370,768.00	0.13
358	002511	中顺洁柔	746,483	8,323,285.45	0.13
359	603568	伟明环保	473,867	8,297,411.17	0.13
360	300776	帝尔激光	127,716	8,288,768.40	0.13
361	000825	太钢不锈	2,137,172	8,270,855.64	0.13
362	601778	晶科科技	1,664,600	8,223,124.00	0.13
363	002985	北摩高科	185,815	8,198,157.80	0.13
364	603883	老百姓	272,567	8,136,124.95	0.13
365	601928	凤凰传媒	711,800	8,114,520.00	0.13
366	603228	景旺电子	315,880	8,102,322.00	0.13
367	600663	陆家嘴	820,393	8,097,278.91	0.13
368	600737	中粮糖业	996,986	8,025,737.30	0.13
369	600967	内蒙一机	794,194	8,021,359.40	0.12
370	603225	新风鸣	712,916	7,877,721.80	0.12
371	688281	华秦科技	38,899	7,877,047.50	0.12
372	600155	华创云信	1,265,000	7,868,300.00	0.12
373	600297	广汇汽车	3,781,100	7,864,688.00	0.12
374	600801	华新水泥	634,825	7,840,088.75	0.12
375	300861	美畅股份	179,300	7,776,241.00	0.12

376	601098	中南传媒	669,700	7,768,520.00	0.12
377	603529	爱玛科技	241,100	7,768,242.00	0.12
378	688778	厦钨新能	156,918	7,767,441.00	0.12
379	002791	坚朗五金	119,900	7,758,729.00	0.12
380	300482	万孚生物	290,038	7,723,711.94	0.12
381	002468	申通快递	713,600	7,721,152.00	0.12
382	688208	道通科技	253,890	7,695,405.90	0.12
383	002745	木林森	830,236	7,638,171.20	0.12
384	000012	南玻 A	1,279,992	7,628,752.32	0.12
385	001227	兰州银行	2,655,100	7,593,586.00	0.12
386	603866	桃李面包	745,686	7,546,342.32	0.12
387	002032	苏泊尔	150,840	7,542,000.00	0.12
388	600871	石化油服	3,795,300	7,514,694.00	0.12
389	000156	华数传媒	863,700	7,514,190.00	0.12
390	600500	中化国际	1,339,410	7,447,119.60	0.12
391	688690	纳微科技	189,686	7,369,301.10	0.11
392	000581	威孚高科	467,490	7,362,967.50	0.11
393	000401	冀东水泥	991,300	7,305,881.00	0.11
394	002867	周大生	408,998	7,271,984.44	0.11
395	301029	怡合达	161,960	7,236,372.80	0.11
396	688276	百克生物	115,471	7,228,484.60	0.11
397	002250	联化科技	688,650	7,203,279.00	0.11
398	600556	天下秀	1,011,195	7,169,372.55	0.11
399	601118	海南橡胶	1,595,900	7,149,632.00	0.11
400	688029	南微医学	87,567	7,141,964.52	0.11
401	601611	中国核建	844,500	7,136,025.00	0.11
402	600022	山东钢铁	4,987,320	7,081,994.40	0.11
403	688520	神州细胞	124,559	7,067,477.66	0.11
404	000930	中粮科技	869,227	7,040,738.70	0.11
405	000785	居然之家	1,826,100	6,957,441.00	0.11
406	002010	传化智联	1,306,400	6,950,048.00	0.11
407	300850	新强联	184,680	6,903,338.40	0.11
408	688006	杭可科技	226,383	6,897,890.01	0.11
409	002423	中粮资本	859,200	6,873,600.00	0.11
410	601598	中国外运	1,470,000	6,850,200.00	0.11
411	601608	中信重工	1,618,243	6,812,803.03	0.11
412	600259	广晟有色	188,411	6,809,173.54	0.11
413	600062	华润双鹤	389,346	6,782,407.32	0.11
414	002505	鹏都农牧	3,565,730	6,739,229.70	0.11
415	000559	万向钱潮	1,232,061	6,714,732.45	0.10
416	002081	金螳螂	1,485,293	6,698,671.43	0.10
417	600597	光明乳业	642,923	6,686,399.20	0.10
418	000089	深圳机场	955,991	6,644,137.45	0.10

419	600782	新钢股份	1,783,700	6,617,527.00	0.10
420	603826	坤彩科技	131,400	6,570,000.00	0.10
421	300618	寒锐钴业	202,140	6,551,357.40	0.10
422	000958	电投产融	1,505,700	6,519,681.00	0.10
423	600901	江苏金租	1,559,500	6,440,735.00	0.10
424	603638	艾迪精密	313,260	6,428,095.20	0.10
425	600707	彩虹股份	1,338,200	6,369,832.00	0.10
426	600339	中油工程	1,561,500	6,355,305.00	0.10
427	000937	冀中能源	988,300	6,305,354.00	0.10
428	600409	三友化工	1,154,856	6,293,965.20	0.10
429	688052	纳芯微	39,574	6,267,334.38	0.10
430	600095	湘财股份	799,600	6,236,880.00	0.10
431	000898	鞍钢股份	2,234,550	6,212,049.00	0.10
432	688107	安路科技	111,907	6,198,528.73	0.10
433	601187	厦门银行	1,230,200	6,175,604.00	0.10
434	002761	浙江建投	403,600	6,126,648.00	0.10
435	603707	健友股份	452,359	6,106,846.50	0.10
436	601718	际华集团	2,047,200	6,080,184.00	0.09
437	000537	广宇发展	520,900	6,078,903.00	0.09
438	000415	渤海租赁	2,882,943	6,054,180.30	0.09
439	600507	方大特钢	1,304,373	6,039,246.99	0.09
440	000967	盈峰环境	1,185,645	5,987,507.25	0.09
441	001914	招商积余	395,734	5,955,796.70	0.09
442	600167	联美控股	853,250	5,947,152.50	0.09
443	688234	天岳先进	80,126	5,924,516.44	0.09
444	601568	北元集团	1,111,000	5,854,970.00	0.09
445	600968	海油发展	1,895,400	5,818,878.00	0.09
446	000563	陕国投 A	1,907,079	5,816,590.95	0.09
447	600808	马钢股份	2,251,300	5,785,841.00	0.09
448	601156	东航物流	444,100	5,773,300.00	0.09
449	002925	盈趣科技	291,779	5,660,512.60	0.09
450	300257	开山股份	370,548	5,621,213.16	0.09
451	600195	中牧股份	475,982	5,559,469.76	0.09
452	002705	新宝股份	308,265	5,558,017.95	0.09
453	603650	彤程新材	167,026	5,478,452.80	0.09
454	600126	杭钢股份	1,259,440	5,465,969.60	0.09
455	300442	润泽科技	176,380	5,425,448.80	0.08
456	600764	中国海防	198,901	5,414,085.22	0.08
457	603379	三美股份	227,676	5,352,662.76	0.08
458	002608	江苏国信	704,400	5,332,308.00	0.08
459	688185	康希诺	64,207	5,232,870.50	0.08
460	000959	首钢股份	1,458,047	5,103,164.50	0.08
461	000402	金融街	1,114,600	5,037,992.00	0.08

462	603786	科博达	75,300	4,947,210.00	0.08
463	002653	海思科	207,790	4,903,844.00	0.08
464	601828	美凯龙	1,010,596	4,840,754.84	0.08
465	002110	三钢闽光	1,142,759	4,822,442.98	0.08
466	001203	大中矿业	422,000	4,688,420.00	0.07
467	002563	森马服饰	753,500	4,686,770.00	0.07
468	688819	天能股份	126,884	4,674,406.56	0.07
469	688289	圣湘生物	275,323	4,636,439.32	0.07
470	601298	青岛港	659,500	4,596,715.00	0.07
471	600377	宁沪高速	462,500	4,546,375.00	0.07
472	601228	广州港	1,406,900	4,544,287.00	0.07
473	603056	德邦股份	287,199	4,428,608.58	0.07
474	600927	永安期货	271,400	4,412,964.00	0.07
475	000031	大悦城	1,198,783	4,387,545.78	0.07
476	600623	华谊集团	704,200	4,387,166.00	0.07
477	600928	西安银行	1,243,100	4,375,712.00	0.07
478	603317	天味食品	297,979	4,353,473.19	0.07
479	601869	长飞光纤	114,271	4,229,169.71	0.07
480	600350	山东高速	630,000	4,013,100.00	0.06
481	002399	海普瑞	348,758	4,000,254.26	0.06
482	601136	首创证券	280,300	3,971,851.00	0.06
483	601139	深圳燃气	536,400	3,910,356.00	0.06
484	000869	张裕 A	127,362	3,904,918.92	0.06
485	601969	海南矿业	570,000	3,750,600.00	0.06
486	001872	招商港口	216,142	3,732,772.34	0.06
487	600995	南网储能	327,700	3,607,977.00	0.06
488	002945	华林证券	251,700	3,443,256.00	0.05
489	000553	安道麦 A	406,200	3,428,328.00	0.05
490	688105	诺唯赞	111,882	3,411,282.18	0.05
491	688248	南网科技	78,973	3,031,773.47	0.05
492	600299	安迪苏	375,000	2,988,750.00	0.05
493	601158	重庆水务	537,000	2,985,720.00	0.05
494	603868	飞科电器	44,605	2,814,129.45	0.04
495	688295	中复神鹰	75,518	2,770,000.24	0.04
496	603355	莱克电气	107,638	2,735,081.58	0.04
497	600032	浙江新能	201,900	2,535,864.00	0.04
498	600956	新天绿能	284,500	2,480,840.00	0.04
499	300741	华宝股份	115,400	2,471,868.00	0.04
500	002901	大博医疗	54,000	1,678,320.00	0.03

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000540	*ST 中天	3,046,725	1,218,690.00	0.02

2	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.00
3	688249	晶合集成	7,405	133,734.30	0.00
4	688472	阿特斯	6,261	106,687.44	0.00
5	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.00
6	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00
7	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.00
8	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.00
9	301260	格力博	3,121	73,749.23	0.00
10	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.00
11	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
12	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
13	688484	南芯科技	1,008	37,003.68	0.00
14	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
15	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
16	601061	中信金属	4,016	30,441.28	0.00
17	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
18	688576	西山科技	240	28,898.40	0.00
19	301246	宏源药业	931	28,591.01	0.00
20	688352	颀中科技	2,361	28,497.27	0.00
21	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
22	301310	鑫宏业	409	26,760.87	0.00
23	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00
24	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
25	301303	真兰仪表	1,058	23,614.56	0.00
26	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
27	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
28	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
29	301322	绿通科技	392	20,870.08	0.00
30	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
31	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
32	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
33	301262	海看股份	692	17,646.00	0.00
34	301383	天键股份	493	17,609.96	0.00
35	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
36	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
37	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
38	688623	二元科技	178	15,448.62	0.00
39	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
40	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
41	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
42	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
43	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
44	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00



45	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
46	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
47	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
48	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
49	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
50	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
51	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
52	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
53	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
54	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
55	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
56	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
57	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
58	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
59	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
60	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
61	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
62	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
63	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
64	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
65	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
66	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
67	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
68	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
69	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
70	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
71	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
72	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
73	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
74	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
75	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
76	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
77	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
78	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
79	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
80	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
81	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688777	中控技术	60,466,850.73	0.73

2	688099	晶晨股份	59,523,909.12	0.72
3	600563	法拉电子	54,671,724.91	0.66
4	603605	珀莱雅	51,994,283.30	0.63
5	688122	西部超导	50,997,601.91	0.62
6	603345	安井食品	44,894,354.17	0.54
7	603688	石英股份	38,324,101.01	0.46
8	603737	三棵树	37,268,200.45	0.45
9	600372	中航电子	37,007,141.10	0.45
10	600486	扬农化工	30,362,341.71	0.37
11	688002	睿创微纳	30,097,700.30	0.36
12	603267	鸿远电子	29,406,774.83	0.36
13	600157	永泰能源	29,356,192.00	0.36
14	603026	胜华新材	29,043,289.57	0.35
15	688256	寒武纪	28,715,838.88	0.35
16	603893	瑞芯微	27,048,555.11	0.33
17	600489	中金黄金	26,578,547.66	0.32
18	603606	东方电缆	26,391,351.00	0.32
19	688208	道通科技	25,271,503.26	0.31
20	600079	人福医药	25,261,357.78	0.31

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688122	西部超导	89,697,279.33	1.09
2	603605	珀莱雅	84,281,752.27	1.02
3	603345	安井食品	82,074,335.11	0.99
4	688777	中控技术	75,454,420.48	0.91
5	688099	晶晨股份	68,974,864.14	0.84
6	600563	法拉电子	65,656,126.22	0.80
7	603606	东方电缆	55,829,344.39	0.68
8	603613	国联股份	49,955,096.55	0.61
9	601699	潞安环能	49,935,427.29	0.60
10	603688	石英股份	49,154,558.24	0.60
11	601607	上海医药	47,344,055.67	0.57
12	603737	三棵树	46,962,820.72	0.57
13	600157	永泰能源	44,000,286.00	0.53
14	601872	招商轮船	42,847,127.58	0.52
15	688063	派能科技	40,169,970.31	0.49
16	600486	扬农化工	40,071,335.96	0.49
17	600487	亨通光电	36,969,564.34	0.45
18	600079	人福医药	36,940,451.00	0.45
19	600026	中远海能	36,890,975.99	0.45
20	600096	云天化	36,811,153.71	0.45

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	4,544,232,870.56
卖出股票收入（成交）总额	5,837,878,844.60

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 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。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

#### 7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

### 7.12 投资组合报告附注

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

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。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	9,804,486.74
2	应收清算款	271,355.27
3	应收股利	2,958,198.07
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	309,104.73
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,343,144.81

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	300308	中际旭创	15,408,525.00	0.24	转融通出借证券
2	688256	寒武纪	6,410,800.00	0.10	转融通出借证券
3	000988	华工科技	6,229,839.00	0.10	转融通出借证券
4	002340	格林美	5,784,361.00	0.09	转融通出借证券
5	002384	东山精密	5,767,930.00	0.09	转融通出借证券
6	002422	科伦药业	5,695,592.00	0.09	转融通出借证券
7	600372	中航电子	5,543,736.00	0.09	转融通出借证券
8	300418	昆仑万维	5,494,192.00	0.09	转融通出借证券
9	300012	华测检测	5,350,800.00	0.08	转融通出借证券
10	600157	永泰能源	5,141,252.00	0.08	转融通出借证券

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000540	*ST 中天	1,218,690.00	0.02	重大事项停牌
2	301395	仁信新材	124,755.68	0.00	新发未上市
2	301395	仁信新材	13,873.60	0.00	新股锁定

3	688249	晶合集成	133,734.30	0.00	新股锁定
4	688472	阿特斯	106,687.44	0.00	新股锁定
5	301358	湖南裕能	86,766.47	0.00	新股锁定

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

#### 8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
15,623	66,124.94	951,305,677.00	92.09	81,764,254.00	7.91

#### 8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

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	352,967,008.00	34.17

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	中国银河证券股份有 限公司	136,974,200.00	13.26
2	中国平安人寿保险股 份有限公司一分红一 个险分红	116,524,100.00	11.28
3	中国平安人寿保险股 份有限公司一自有资 金	82,519,200.00	7.99
4	中信证券股份有限公 司	44,995,884.00	4.36
5	中信建投证券股份有 限公司	18,008,952.00	1.74
6	招商证券股份有限公 司	17,866,757.00	1.73
7	中国平安财产保险股 份有限公司一传统一 普通保险产品	16,398,700.00	1.59
8	国泰君安证券股份有	13,457,964.00	1.30

	限公司		
9	BARCLAYS BANK PLC	12,246,136.00	1.19
10	华泰证券股份有限公司	11,707,701.00	1.13
11	嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	352,967,008.00	34.17

注：上述基金持有人份额均为场内基金份额。

### 8.3 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

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（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	1,378,269,931.00
本报告期基金总申购份额	961,600,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,306,800,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	1,033,069,931.00

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### （1）基金管理人的重大人事变动情况

2023年4月29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》，张峰先生任公司副总经理。

2023年4月29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》，程剑先生任公司副总经理。

2023 年 4 月 29 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》，李明先生任公司财务总监。

2023 年 6 月 20 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》，姚志鹏先生任公司副总经理。

#### (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。

### 10.3 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。

### 10.4 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。

### 10.5 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，会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信建投证券股份有限公司	6	7,528,831,946.92	72.63	935,279.18	33.93	-
开源证券股份有限公司	2	1,203,541,393.14	11.61	759,850.11	27.57	-
广发证券股份有限公司	3	579,873,224.29	5.59	375,994.88	13.64	-

公司						
长江证券股份有限公司	1	534,735,272.15	5.16	337,591.30	12.25	-
兴业证券股份有限公司	2	145,875,323.78	1.41	92,103.26	3.34	-
申万宏源证券有限公司	2	137,458,452.91	1.33	96,221.31	3.49	-
海通证券股份有限公司	1	83,916,271.30	0.81	58,741.61	2.13	-
招商证券股份有限公司	1	47,502,516.16	0.46	33,252.52	1.21	-
安信证券股份有限公司	2	45,254,298.33	0.44	28,571.04	1.04	-
华泰证券股份有限公司	1	23,166,511.77	0.22	16,217.25	0.59	-
西部证券股份有限公司	2	22,738,431.16	0.22	14,355.11	0.52	-
中航证券有限公司	2	12,610,537.37	0.12	7,961.14	0.29	-
财信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
高盛(中国)证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国元证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-



股份有限 公司						
银泰证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-

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. 高盛高华证券有限责任公司更名为高盛（中国）证券有限责任公司。

4. 报告期内，本基金退租以下交易单元：国盛证券有限责任公司退租交易单元 2 个。

5. 报告期内，本基金新增以下交易单元：银泰证券有限责任公司新增交易单元 1 个，中航证券有限公司新增交易单元 2 个。

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	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	-	-	17,000,000.00	100.00	-	-
开源证券股份有限公司	2,936,543.08	91.67	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	266,867.44	8.33	-	-	-	-
长江证券股份	-	-	-	-	-	-

有限公司						
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中航证券有限公司	-	-	-	-	-	-
财信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
高盛(中国)证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国元证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
银泰证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	嘉实基金管理有限公司关于防范不法分子诈骗活动的提示性公告	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	2023年3月21日
2	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	2023年4月19日
3	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	2023年4月29日
4	关于嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商终止的公告	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	2023年5月15日
5	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	2023年5月30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	2023年5月31日
7	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	2023年6月20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	2023年6月29日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
联接基金	1	2023-01-01 至 2023-06-30	355,502,628.00	88,631,800.00	91,167,420.00	352,967,008.00	34.17
产品特有风险							
<p>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。</p> <p>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。</p>							

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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。

### 12.2 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

### 12.3 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 8 月 29 日