

汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

送出日期：2023 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
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	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
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	17
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	18
5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	18
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表	18
6.2 利润表	19
6.3 净资产（基金净值）变动表	20
6.4 报表附注	22
§ 7 投资组合报告	121
7.1 期末基金资产组合情况	121
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	122
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	123
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	147
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	148
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	148
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	149
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	149
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	149

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	149
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	149
7.12 投资组合报告附注.....	149
§ 8 基金份额持有人信息.....	151
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	151
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	152
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	152
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.....	153
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况.....	153
§ 9 开放式基金份额变动.....	153
§ 10 重大事件揭示.....	153
10.1 基金份额持有人大会决议.....	154
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.....	154
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	154
10.4 基金投资策略的改变.....	154
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	154
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.....	154
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	154
10.8 其他重大事件.....	156
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	156
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况.....	156
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	156
§ 12 备查文件目录.....	156
12.1 备查文件目录.....	156
12.2 存放地点.....	157
12.3 查阅方式.....	157

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）	
基金简称	汇添富中证 500 指数（LOF）	
基金主代码	501036	
基金运作方式	上市契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 08 月 10 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额（份）	367,709,962.74	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所	
上市日期	2017 年 10 月 09 日	
下属分级基金的基金简称	汇添富中证 500 指数（LOF）A	汇添富中证 500 指数（LOF）C
下属分级基金场内简称	中证 500A	中证 500C
下属分级基金的交易代码	501036	501037
报告期末下属分级基金的份额总额（份）	252,978,171.99	114,731,790.75

注：汇添富中证 500 指数（LOF）A 类份额扩位证券简称：中证 500LOF；汇添富中证 500 指数（LOF）C 类份额扩位证券简称：中证 500LOFC。

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	本基金采用被动式指数化投资方法，按照标的指数的成份股及其权重来构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，以更好地实现本基金的投资目标。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。本基金的投资策略主要包括：股票投资策略、固定收益类资产投资策略、金融衍生工具投资策略、融资及转融通投资策略、存托凭证的投资策略。

业绩比较基准	中证 500 指数收益率*95%+银行人民币活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金，具有与标的指数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	汇添富基金管理股份有限公司	招商证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏
	联系电话	021-28932888
	电子邮箱	service@99fund.com
客户服务电话	400-888-9918	95565
传真	021-28932998	0755-82960794
注册地址	上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号
办公地址	上海市黄浦区外马路 728 号	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号
邮政编码	200010	518000
法定代表人	李文	霍达

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金中期报告备置地点	上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

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	报告期(2023 年 01 月 01 日 - 2023 年 06 月 30 日)
--------------	--

标	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C
本期已实现收益	-2,957,586.26	-1,501,919.16
本期利润	9,715,348.33	5,678,779.30
加权平均基金份额本期利润	0.0386	0.0479
本期加权平均净值利润率	3.37%	4.23%
本期基金份额净值增长率	3.32%	3.21%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023 年 06 月 30 日)	
期末可供分配利润	31,002,333.88	12,311,475.02
期末可供分配基金份额利润	0.1225	0.1073
期末基金资产净值	283,980,505.87	127,043,265.77
期末基金份额净值	1.1225	1.1073
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023 年 06 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	12.25%	10.73%

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、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：基金的申购赎回费等），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

汇添富中证 500 指数 (LOF) A						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.04%	0.90%	-0.77%	0.89%	0.81%	0.01%
过去三	-3.90%	0.79%	-5.10%	0.78%	1.20%	0.01%

个月						
过去六个月	3.32%	0.75%	2.20%	0.75%	1.12%	0.00%
过去一年	-5.11%	0.90%	-6.65%	0.91%	1.54%	-0.01%
过去三年	18.08%	1.11%	2.48%	1.13%	15.60%	-0.02%
自基金合同生效日起至今	12.25%	1.25%	-4.43%	1.27%	16.68%	-0.02%
汇添富中证 500 指数 (LOF) C						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.03%	0.90%	-0.77%	0.89%	0.80%	0.01%
过去三个月	-3.95%	0.79%	-5.10%	0.78%	1.15%	0.01%
过去六个月	3.21%	0.75%	2.20%	0.75%	1.01%	0.00%
过去一年	-5.34%	0.90%	-6.65%	0.91%	1.31%	-0.01%
过去三年	17.21%	1.11%	2.48%	1.13%	14.73%	-0.02%
自基金合同生效日起至今	10.73%	1.25%	-4.43%	1.27%	15.16%	-0.02%

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

汇添富中证500指数（LOF）A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富中证500指数（LOF）C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2017年08月10日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金成立于 2005 年 2 月，是中国一流的综合性资产管理公司之一。公司总部设立于上海，在北京、上海、广州、成都、南京、深圳等地设有分公司，在香港、上海、美国设有子公司——汇添富资产管理（香港）有限公司、汇添富资本管理有限公司、汇添富资产管理（美国）控股有限公司。公司及旗下子公司业务牌照齐全，拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII 基金管理人、RQFII 基金管理人、QFII 基金管理人、基金投资顾问等业务资格。

汇添富基金现已形成公募业务、私募资管业务、私募股权业务、养老金业务、电商业务、国际业务、基金投顾业务等七大业务板块，被誉为“选股专家”，赢得广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

成立以来，公司屡获殊荣，包括“金牛奖”“金基金奖”“明星基金奖”等多项权威荣誉奖项。汇添富始终坚持“客户第一”的价值观和“一切从长期出发”的经营理念，致力于打造中国最受认可的资产管理品牌。

2023 上半年，汇添富基金新成立 27 只公开募集证券投资基金，包括 10 只股票型基金、9 只混合型基金、8 只债券型基金。截至 2023 年 6 月 30 日，公司共管理 297 只公开募集证券投资基金，形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征，较为完善、有效的产品线。

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（年）	说明
		任职日期	离任日期		
吴振翔	本基金的基金经理，指数与量化投资部副总监	2017 年 08 月 10 日		17	国籍：中国。学历：中国科学技术大学管理学博士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究

				<p>员、上投摩根基金管理有限公司产品开发高级经理。2008 年 3 月加入汇添富基金管理股份有限公司, 历任产品开发高级经理、数量投资高级分析师、基金经理助理, 现任指数与量化投资部副总监。2010 年 2 月 6 日至今任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2011 年 9 月 16 日至 2013 年 11 月 7 日任深证 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2011 年 9 月 28 日至 2013 年 11 月 7 日任汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至</p>
--	--	--	--	---

				<p>2015 年 11 月 2 日任中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 11 月 6 日至今任汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2015 年 2 月 16 日至 2023 年 4 月 24 日任汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金的基金经理。2015 年 3 月 24 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。</p> <p>2016 年 1 月 21 日至今任汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2016 年 7 月 28 日至今任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月 22 日至</p>
--	--	--	--	--

				<p>今任汇添富中证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2017 年 8 月 10 日至今任汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2018 年 3 月 23 日至今任汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理。2019 年 7 月 26 日至 2022 年 6 月 13 日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 9 月 24 日至 2022 年 6 月 13 日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 11 月 6 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 3 月 5 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数</p>
--	--	--	--	---

					<p>证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 10 月 29 日至今任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2022 年 1 月 11 日至今任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。</p> <p>2022 年 1 月 27 日至今任汇添富中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2022 年 4 月 28 日至今任汇添富中证沪港深张江自主创新 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 4 月 25 日至今任汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月 6 日至今任汇添富量化选股混合型证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

注:1、基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期;

2、非首任基金经理,其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期

和解聘日期;

3、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注:截至本报告期末,本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定,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。本基金无重大违法、违规行为,本基金投资运作符合有关法规及基金合同的约定。

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

本基金管理人通过建立事前、事中和事后全程嵌入式的管控模式,确保公平交易制度的执行和实现。具体情况如下:

一、本基金管理人建立了内部公平交易管理规范 and 流程,以确保公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种及投资管理的各个环节。

二、本着“时间优先、价格优先”的原则,对同一证券有相同交易需求的投资组合采用交易系统中的公平交易模块,实现事中交易执行层面的公平管控。

三、对不同投资组合进行同向交易价差分析,具体方法为:在不同时间窗口(日内、3日内、5日内)下,对不同组合同一证券同向交易的平均价差率进行 T 检验。对于未通过 T 检验的交易,再根据同向交易占优比、交易价格、交易频率、交易数量和交易时间等进行具体分析,进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

四、对于反向交易,根据交易顺序、交易时间窗口跨度、交易价格、交易数量占市场成交量比值、组合规模、市场收益率变化等综合判断交易是否涉及利益输送。

综上,本基金管理人通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估,严格执行了公平交易制度,公平对待了旗下各投资组合。本报告期内,未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内,本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况有 25 次,投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控,事后对交易时点、交易

数量、交易价差等多方面进行综合分析,未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

2023 年上半年,资本市场先在经济复苏背景下显现出修复行情,二季度市场整体显著回调。

上半年美联储累计加息三次,将联邦基金目标利率提升至 5.00%-5.25%区间。3 月议息会议声明文件对未来继续加息的表述有所弱化,5 月暗示后续加息暂缓但年内仍较难降息。市场普遍预期本轮加息周期接近尾声,但转向降息周期仍然需要一定时间。

全球来看,海外通胀回落速度较为缓慢,美元指数二季度阶段性走强,人民币兑美元贬值压力加大。北向资金二季度小幅净流入,较一季度显著放缓。

国内来看,3 月两会召开,仍然坚持以稳增长为中心,加强协同,共同促进高质量发展。经济数据在二季度普遍表现疲软。GDP 增速低于市场预期。6 月官方制造业 PMI 数据 49,较前值小幅企稳,但仍低于 50。1-5 月规模以上工业企业营业收入累计同比增长 0.1%,利润累计同比下滑 18.8%,相较 1-4 月累计营收增速下滑、累计利润增速降幅有所收窄。国内经济整体仍处于弱复苏阶段,内需修复动力不足、外需增长压力较大,经济发展模式转型阶段存在压力和挑战。在稳增长压力较大的背景下,政策层面有望持续发力。6 月 MLF 下调 10 个基点,随后一年期、五年期 LPR 均下调 10 个基点,有望减轻企业融资成本、居民债务负担压力。

二季度市场有所回调,行业主题结构性分化显著。一季度表现强势的计算机、通信等板块在 4 月和 5 月显著回调,6 月开始重新受到市场关注。银行、证券等金融类资产则是 4 月表现强势之后进入回调。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富中证 500 指数 (LOF) A 类份额净值增长率为 3.32%,同期业绩比较基准收益率为 2.20%。本报告期汇添富中证 500 指数 (LOF) C 类份额净值增长率为 3.21%,同期业绩比较基准收益率为 2.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年经济呈现弱复苏状态,复苏强度低于年初预期。分项来看,工业制造和投资相对具有韧性,消费和出口较为疲弱。但居民消费倾向有抬升迹象,结合收入提升预期,下半年内需动能有望出现改善。国内政策基调仍以稳增长为主,尽管难有强刺激,但或许可以期待整体托底和结构性的支持政策。

资本市场上半年整体表现为震荡修复。业绩角度来看, A 股整体盈利增速尚未明显改善, 结构分化仍然较为显著, 但在当前市场整体估值较低的阶段, 权益市场整体性机会在增加。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定, 对基金所持有的投资品种进行估值, 并保持估值政策和程序的一贯性。

本基金管理人设有估值委员会, 估值委员会负责构建估值决策体系、适时更新估值相关制度、指导并监督各类投资品种的估值程序。估值委员会由投资、研究、集中交易、合规稽核、风险管理、基金营运等部门中具有丰富从业经验和专业胜任能力的员工担任, 且互相不存在直接的重大利益冲突。基金经理可参与估值委员会对于估值方法的讨论, 但无最终决策权, 从而将其影响程度进行适当限制, 保证基金估值的公平、合理。

基金日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行, 基金份额净值由管理人完成估值后, 经托管人复核无误后由管理人对外公布。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定: 本基金收益分配方式分两种: 现金分红与红利再投资。登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额, 可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资; 若投资者不选择, 本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在基金份额持有人上海证券账户下的基金份额, 只能选择现金分红的方式, 具体权益分配程序等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定。

本基金本报告期内未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期, 招商证券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。

5.3 托管人对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：汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF)

报告截止日：2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	21,111,131.27	23,910,410.75
结算备付金		4,222,699.79	5,793,342.16
存出保证金		1,066,913.14	1,151,715.37
交易性金融资产	6.4.7.2	384,627,979.92	396,763,584.76
其中：股票投资		380,665,300.96	393,096,493.34
基金投资		-	-
债券投资		3,962,678.96	3,667,091.42
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		-	-
应收清算款		205,640.36	-
应收股利		30,024.69	-
应收申购款		581,739.10	1,395,745.54
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.6	15,735.03	14,255.12
资产总计		411,861,863.30	429,029,053.70
负债和净资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	13.18
应付赎回款		358,672.98	1,411,087.61
应付管理人报酬		168,399.49	179,978.11
应付托管费		33,679.92	35,995.60
应付销售服务费		26,118.02	30,199.37
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2,310.15	1,582.55
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	248,911.10	308,868.98
负债合计		838,091.66	1,967,725.40
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	367,709,962.74	394,815,027.56
未分配利润	6.4.7.9	43,313,808.90	32,246,300.74
净资产合计		411,023,771.64	427,061,328.30
负债和净资产总计		411,861,863.30	429,029,053.70

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 367,709,962.74 份。本基金下属汇添富中证 500 指数（LOF）A 基金份额净值 1.1225 元，基金份额总额 252,978,171.99 份；本基金下属汇添富中证 500 指数（LOF）C 基金份额净值 1.1073 元，基金份额总额 114,731,790.75 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023年01月01日 至2023年06月30 日	上年度可比期间 2022年01月01日 至2022年06月30 日
一、营业总收入		16,953,624.19	-38,193,387.29
1. 利息收入		533,093.10	572,815.57
其中：存款利息收入	6.4.7.10	156,676.06	232,329.93

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		-	-
证券出借利息收入		376,417.04	340,485.64
其他利息收入		-	-
2. 投资收益 (损失以“-”填列)		-3,436,260.72	1,190,007.70
其中: 股票投资收益	6.4.7.11	-8,033,580.24	-2,229,055.95
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	58,431.04	9,417.11
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	123,341.76	-1,037,561.64
股利收益	6.4.7.17	4,415,546.72	4,447,208.18
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)	6.4.7.18	19,853,633.05	-39,983,983.88
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	6.4.7.19	3,158.76	27,773.32
减: 二、营业总支出		1,559,496.56	1,465,080.83
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,049,660.06	975,348.91
2. 托管费	6.4.10.2.2	209,932.05	195,069.76
3. 销售服务费		167,127.23	167,174.49
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	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		3,022.21	1,227.23
8. 其他费用	6.4.7.21	129,755.01	126,260.44
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		15,394,127.63	-39,658,468.12
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		15,394,127.63	-39,658,468.12
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		15,394,127.63	-39,658,468.12

6.3 净资产 (基金净值) 变动表

会计主体: 汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF)

本报告期: 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期		
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	394,815,027.56	32,246,300.74	427,061,328.30
加: 会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	394,815,027.56	32,246,300.74	427,061,328.30
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-27,105,064.82	11,067,508.16	-16,037,556.66
(一)、综合收益总额	-	15,394,127.63	15,394,127.63
(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)	-27,105,064.82	-4,326,619.47	-31,431,684.29
其中: 1. 基金申购款	148,223,984.82	20,073,655.99	168,297,640.81
2. 基金赎回款	-175,329,049.64	-24,400,275.46	-199,729,325.10
(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、本期期末净资产(基金净值)	367,709,962.74	43,313,808.90	411,023,771.64
项目	上年度可比期间		
	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	307,839,443.93	96,269,037.58	404,108,481.51
加: 会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	307,839,443.93	96,269,037.58	404,108,481.51
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	57,132,661.74	-31,116,403.83	26,016,257.91
(一)、综合收益	-	-39,658,468.12	-39,658,468.12

总额			
(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）	57,132,661.74	8,542,064.29	65,674,726.03
其中：1. 基金申购款	247,134,666.82	38,067,308.99	285,201,975.81
2. 基金赎回款	-190,002,005.08	-29,525,244.70	-219,527,249.78
(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、本期末净资产（基金净值）	364,972,105.67	65,152,633.75	430,124,739.42

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：

<u>张晖</u>	<u>李骁</u>	<u>雷青松</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”），系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[2017]770 号文《关于准予汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集。基金合同于 2017 年 8 月 10 日生效。首次设立基金募集规模为 735,804,689.63 份基金份额，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）出具安永华明（2017）验字第 60466941_B29 号验资报告予以验证。本基金为上市契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为招商证券股份有限公司。

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，基金还可投资于其他股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债

券（包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（分离交易可转债）、中小企业私募债券等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括定期存款、协议存款及其他银行存款）、货币市场工具、金融衍生工具（包括股指期货、权证、国债期货、股票期权等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金的股票资产及存托凭证投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。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。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率 $\times 95\%$ + 银行人民币活期存款利率（税后） $\times 5\%$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

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

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2. 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》

的规定, 证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为, 暂适用简易计税方法, 按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 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, 已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定 (2011 年修订)》及相关地方教育附加的征收规定, 凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人, 都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加 (除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外) 及地方教育费附加。

4. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定, 自 2004 年 1 月 1 日起, 对证券投资基金 (封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金) 管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入, 继续免征企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定, 股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入, 暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定, 对证券投资基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不征收企业所得税。

5. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定, 股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入, 暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定, 自 2008 年 10 月 9 日起, 对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定, 自 2013 年 1 月 1 日起, 证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票, 持股期限在 1 个月以内 (含 1 个月) 的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在 1 个月以上至 1 年 (含 1 年) 的, 暂减按

50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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 06 月 30 日
活期存款	21,111,131.27
等于：本金	21,104,027.27
加：应计利息	7,104.00
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	-
合计	21,111,131.27

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	404,127,182.52	-	380,665,300.96	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	3,874,775.00	50,566.76	3,962,678.96	37,337.20
	银行间市场	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	3,874,775.00	50,566.76	3,962,678.96	37,337.20

资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	408,001,957.52	50,566.76	384,627,979.92	23,424,544.36

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 06 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
（国债期货投资）	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
（外汇期货投资）	-	-	-	-
权益衍生工具	7,196,400.00	-	-	-
（权证投资）	-	-	-	-
（股指期货投资）	7,196,400.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	7,196,400.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动

IC2309	IC2309	6	7,164,000.00	-32,400.00
合计				-32,400.00
减：可抵销期货暂收款				-32,400.00
净额				-

注：在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的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。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内不存在债权投资减值准备计提情况。

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	15,735.03
待摊费用	-
合计	15,735.03

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-

应付交易费用	93,869.41
其中：交易所市场	93,869.41
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	74,795.19
应付信息披露费	59,507.37
应付指数使用费	20,739.13
应付账户维护费	-
应付汇划费	-
应付上市费	-
应付持有人大会费-公证费	-
应付持有人大会费-律师费	-
其他	-
合计	248,911.10

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富中证 500 指数 (LOF) A		
项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	257,196,188.48	257,196,188.48
本期申购	54,721,594.16	54,721,594.16
本期赎回 (以“-”号填列)	-58,939,610.65	-58,939,610.65
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	252,978,171.99	252,978,171.99
汇添富中证 500 指数 (LOF) C		
项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	137,618,839.08	137,618,839.08
本期申购	93,502,390.66	93,502,390.66
本期赎回 (以“-”号填列)	-116,389,438.99	-116,389,438.99
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	114,731,790.75	114,731,790.75

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

汇添富中证 500 指数 (LOF) A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	84,379,922.26	-62,170,157.05	22,209,765.21
本期利润	-2,957,586.26	12,672,934.59	9,715,348.33
本期基金份额交易产生的变动数	-1,395,584.94	472,805.28	-922,779.66
其中：基金申购款	17,743,245.13	-9,718,083.60	8,025,161.53
基金赎回款	-19,138,830.07	10,190,888.88	-8,947,941.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	80,026,751.06	-49,024,417.18	31,002,333.88
汇添富中证 500 指数 (LOF) C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	43,023,293.05	-32,986,757.52	10,036,535.53
本期利润	-1,501,919.16	7,180,698.46	5,678,779.30
本期基金份额交易产生的变动数	-7,142,941.97	3,739,102.16	-3,403,839.81
其中：基金申购款	28,855,754.89	-16,807,260.43	12,048,494.46
基金赎回款	-35,998,696.86	20,546,362.59	-15,452,334.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	34,378,431.92	-22,066,956.90	12,311,475.02

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

活期存款利息收入	121,183.51
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	34,537.95
其他	954.60
合计	156,676.06

注：“其他”为结算保证金利息收入。

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益——股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-8,033,580.24
股票投资收益——赎回差价收入	-
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	-8,033,580.24

6.4.7.11.2 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 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	94,513,734.39
减：卖出股票成本总额	102,323,934.13
减：交易费用	223,380.50
买卖股票差价收入	-8,033,580.24

6.4.7.11.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期无证券出借差价收入。

6.4.7.12 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	88,792.04

债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付) 差价收入	-30,361.00
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	58,431.04

6.4.7.13.2 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 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
卖出债券 (债转股及债券到期兑付) 成交总额	11,146,980.00
减：卖出债券 (债转股及债券到期兑付) 成本总额	10,930,361.00
减：应计利息总额	246,980.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-30,361.00

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 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 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
股指期货投资收益	123,341.76
外汇远期投资收益	-
外汇期货投资收益	-
国债期货投资收益	-

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	4,415,546.72
其中：证券出借权益补偿收入	306,319.87
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,415,546.72

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	19,772,873.05
——股票投资	19,725,005.85
——债券投资	47,867.20
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	80,760.00
——权证投资	-
——期货投资	80,760.00
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	19,853,633.05

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	3,158.76
替代损益	-
其他	-
合计	3,158.76

6.4.7.20 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	3,362.75
指数使用费	41,986.43
持有人大会-公证费	-
持有人大会-律师费	-
开户费	-
上市费	-
其他	103.27
合计	129,755.01

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内未发生与本基金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。

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
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人, 基金销售机构, 基金发起人
招商证券股份有限公司 (“招商证券”)	基金托管人, 基金代销机构
东方证券股份有限公司 (“东方证券”)	基金管理人的股东, 基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
招商证券	161,071,840.89	100.00	211,128,445.95	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
招商证券	11,114,396.00	100.00	1,552,166.58	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
招商证券	116,182.49	100.00	93,869.41	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)

		(%)		(%)
招商证券	151,646.47	100.00	118,518.48	100.00

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

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 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,049,660.06	975,348.91
其中：支付销售机构的客户维护费	323,719.21	286,890.78

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	209,932.05	195,069.76

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性

支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的, 顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位: 人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C	合计
招商证券股份有限公司	-	119.81	119.81
东方证券股份有限公司	-	6,080.26	6,080.26
汇添富基金管理股份有限公司	-	28,899.29	28,899.29
合计	-	35,099.36	35,099.36
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C	合计
招商证券股份有限公司	-	187.42	187.42
东方证券股份有限公司	-	6,456.64	6,456.64
汇添富基金管理股份有限公司	-	30,960.07	30,960.07
合计	-	37,604.13	37,604.13

注: 本基金 A 类基金份额不收取销售服务费, C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%。本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.25% 年费率计提。

计算方法如下:

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计算, 逐日累计至每月月末, 按月支付, 由基金管理人向基金托管人发送基

金销售服务费划付指令, 基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的, 顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券 (含回购) 交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

单位: 人民币元

本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
东方证券	1,013,232.00	833.46	-	-
招商证券	485,594.00	321.03	-	-
上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
东方证券	33,754,809.00	23,464.23	1,044,276.00	150.68
招商证券	4,315,362.00	2,881.08	257,809.00	106.08

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

单位: 人民币元

本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量 (单位: 股)	出借期限 (单位)	费率	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额

						：				
						天				
)				
东方 证券	202304170000 2240	辽 港 股 份	202 3 年 04 月 17 日	105,294 .00	65,400. 00	14	2.4 0	119. 33	-	-
东方 证券	202304170000 2381	长 飞 光 纤	202 3 年 04 月 17 日	80,724. 00	2,100.0 0	14	2.4 0	91.4 9	-	-
东方 证券	202304170000 2442	小 商 品 城	202 3 年 04 月 17 日	151,240 .00	19,000. 00	14	2.4 0	171. 41	-	-
东方 证券	202304240000 1355	蓝 色 光 标	202 3 年 04 月 24 日	21,940. 00	2,000.0 0	14	3.9 0	33.2 8	-	-
东方 证券	202304240000 1700	珀 莱 雅	202 3 年 04 月 24 日	379,176 .00	2,400.0 0	14	2.2 0	324. 41	-	-
东方 证券	202305080000 2080	蓝 色 光 标	202 3 年 05 月 08 日	151,872 .00	11,200. 00	14	3.4 0	200. 81	-	-

			日							
东方证券	202305080000 2446	小商品城	2023年05月08日	37,924.00	3,800.00	14	2.10	30.97	-	-
东方证券	202305080000 8877	蓝色光标	2023年05月08日	27,120.00	2,000.00	14	3.90	41.13	-	-
东方证券	202305080001 7029	珀莱雅	2023年05月08日	387,696.00	2,400.00	14	2.20	331.70	-	-
招商证券	202305220000 4271	天华新能	2023年05月22日	257,304.00	7,100.00	14	3.60	360.23	-	-
东方证券	202305220003 0572	蓝色光标	2023年05月22日	118,160.00	11,200.00	14	3.40	156.23	-	-
东方证券	202306120003 2624	新大陆	2023年06月12日	38,180.00	2,000.00	14	1.50	22.27	-	-
东	202306120003	昆	202	106,820	2,000.0	14	3.5	145.	-	-

方 证 券	2690	仑 万 维	3 年 06 月 12 日	.00	0		0	39		
东 方 证 券	202306120003 2691	申 通 快 递	202 3 年 06 月 12 日	11,620. 00	1,000.0 0	14	1.1 0	4.97	-	-
东 方 证 券	202306120003 2696	兆 驰 股 份	202 3 年 06 月 12 日	11,120. 00	2,000.0 0	14	2.3 0	9.95	-	-
东 方 证 券	202306120003 2700	朗 新 科 技	202 3 年 06 月 12 日	47,140. 00	2,000.0 0	14	2.6 0	47.6 6	-	-
东 方 证 券	202306120003 2704	鲁 西 化 工	202 3 年 06 月 12 日	21,040. 00	2,000.0 0	14	1.8 0	14.7 3	-	-
东 方 证 券	202306120003 2705	华 天 科 技	202 3 年 06 月 12 日	18,780. 00	2,000.0 0	14	2.3 0	16.8 0	-	-
东 方 证 券	202306120003 2706	东 华 软	202 3 年	15,260. 00	2,000.0 0	14	2.3 0	13.6 5	-	-

券		件	06 月 12 日							
东方证 券	202306120003 2709	网 宿 科 技	202 3 年 06 月 12 日	16,480. 00	2,000.0 0	14	3.0 0	19.2 3	-	-
东方证 券	202306120003 2727	索 菲 亚	202 3 年 06 月 12 日	35,800. 00	2,000.0 0	14	1.5 0	20.8 8	-	-
东方证 券	202306120003 2729	光 启 技 术	202 3 年 06 月 12 日	29,720. 00	2,000.0 0	14	2.3 0	26.5 8	-	-
东方证 券	202306120003 2730	中 材 科 技	202 3 年 06 月 12 日	39,440. 00	2,000.0 0	14	1.7 0	26.0 7	-	-
东方证 券	202306120003 2734	海 思 科	202 3 年 06 月 12 日	49,100. 00	2,000.0 0	14	2.2 0	42.0 1	-	-
东方证 券	202306120003 2736	华 西 证 券	202 3 年 06 月	16,480. 00	2,000.0 0	14	2.1 0	13.4 6	-	-

			12 日							
东方 证券	202306120003 2745	新兴 铸管	202 3 年 06 月 12 日	4,160.0 0	1,000.0 0	14	1.5 0	2.43	-	-
东方 证券	202306120003 2749	长川 科技	202 3 年 06 月 12 日	99,100. 00	2,000.0 0	14	2.6 0	100. 20	-	-
东方 证券	202306120003 2766	卫宁 健康	202 3 年 06 月 12 日	10,080. 00	1,000.0 0	14	2.6 0	10.1 9	-	-
东方 证券	202306120003 2771	多氟 多	202 3 年 06 月 12 日	39,020. 00	2,000.0 0	14	2.3 0	34.9 0	-	-
东方 证券	202306120003 2810	石基 信息	202 3 年 06 月 12 日	38,440. 00	2,000.0 0	14	2.3 0	34.3 8	-	-
东方 证券	202306120003 2831	蓝色 光标	202 3 年 06 月 12 日	21,480. 00	2,000.0 0	14	3.0 0	25.0 6	-	-

东方 证券	202306120003 2839	景 嘉 微	202 3 年 06 月 12 日	92,770. 00	1,000.0 0	14	3.5 0	126. 27	-	-
东方 证券	202306120003 2840	巨 化 股 份	202 3 年 06 月 12 日	27,320. 00	2,000.0 0	14	2.3 0	24.4 4	-	-
东方 证券	202306120003 2843	海 信 视 像	202 3 年 06 月 12 日	45,700. 00	2,000.0 0	14	1.4 0	24.8 8	-	-
东方 证券	202306120003 2846	唐 山 港	202 3 年 06 月 12 日	7,220.0 0	2,000.0 0	14	1.4 0	3.93	-	-
东方 证券	202306120003 2856	抚 顺 特 钢	202 3 年 06 月 12 日	17,220. 00	2,000.0 0	14	1.8 0	12.0 5	-	-
东方 证券	202306120003 2880	中 银 证 券	202 3 年 06 月 12 日	21,020. 00	2,000.0 0	14	2.3 0	18.8 0	-	-
东 方	202306120003 2904	中 国	202 3	26,300. 00	1,000.0 0	14	2.1 0	21.4 8	-	-

证 券		海 防	年 06 月 12 日							
东 方 证 券	202306120003 2909	复 旦 微 电	202 3 年 06 月 12 日	53,340. 00	1,000.0 0	14	3.2 0	66.3 8	-	-
东 方 证 券	202306120003 2913	四 川 长 虹	202 3 年 06 月 12 日	10,200. 00	2,000.0 0	14	2.3 0	9.12	-	-
招 商 证 券	202306120003 2923	D R 中 控 技	202 3 年 06 月 12 日	89,330. 00	1,000.0 0	14	3.2 0	111. 17	-	-
东 方 证 券	202306120003 2944	江 淮 汽 车	202 3 年 06 月 12 日	24,260. 00	2,000.0 0	14	1.2 0	11.3 2	-	-
东 方 证 券	202306120003 2962	中 国 动 力	202 3 年 06 月 12 日	37,040. 00	2,000.0 0	14	2.3 0	33.1 3	-	-
东 方 证 券	202306120003 2966	X D 航 天	202 3 年 06	28,860. 00	2,000.0 0	14	1.0 0	11.2 2	-	-

		信	月 12 日							
东方 证 券	202306120003 2967	中 国 西 电	202 3 年 06 月 12 日	10,560. 00	2,000.0 0	14	2.2 0	9.03	-	-
东方 证 券	202306120003 3015	烽 火 通 信	202 3 年 06 月 12 日	42,880. 00	2,000.0 0	14	1.8 0	30.0 2	-	-
东方 证 券	202306120003 3017	五 矿 资 本	202 3 年 06 月 12 日	11,000. 00	2,000.0 0	14	1.5 0	6.42	-	-
东方 证 券	202306120003 3018	江 苏 有 线	202 3 年 06 月 12 日	3,690.0 0	1,000.0 0	14	2.0 0	2.87	-	-
东方 证 券	202306120003 3061	中 信 重 工	202 3 年 06 月 12 日	3,970.0 0	1,000.0 0	14	1.0 0	1.54	-	-
东方 证 券	202306120003 3103	中 航 高 科	202 3 年 06 月 12 日	22,700. 00	1,000.0 0	14	2.3 0	20.3 0	-	-

			日							
东方证券	2023061200033117	上海电力	2023年06月12日	21,640.00	2,000.00	14	2.30	19.36	-	-
东方证券	2023061200033205	芯原股份	2023年06月12日	177,340.00	2,000.00	14	2.60	179.31	-	-
东方证券	2023061200033238	华发股份	2023年06月12日	21,520.00	2,000.00	14	2.30	19.25	-	-
东方证券	2023061200033297	物产中大	2023年06月12日	10,160.00	2,000.00	14	1.50	5.93	-	-
东方证券	2023061200033320	辽港股份	2023年06月12日	197,500.00	125,000.00	14	2.40	184.33	-	-
东方证券	2023061200033341	中铁工业	2023年06月12日	19,220.00	2,000.00	14	2.00	14.95	-	-
东	202306120003	石	202	313,200	3,000.0	14	2.4	292.	-	-

方 证 券	3401	英 股 份	3 年 06 月 12 日	.00	0		0	32		
东 方 证 券	202306120003 3416	永 泰 能 源	202 3 年 06 月 12 日	2,780.0 0	2,000.0 0	14	2.1 0	2.27	-	-
东 方 证 券	202306120003 3531	兴 发 集 团	202 3 年 06 月 12 日	22,340. 00	1,000.0 0	14	2.3 0	19.9 8	-	-
东 方 证 券	202306120003 3617	湘 财 股 份	202 3 年 06 月 12 日	15,200. 00	2,000.0 0	14	2.3 0	13.6 0	-	-
东 方 证 券	202306120003 3730	中 文 传 媒	202 3 年 06 月 12 日	34,220. 00	2,000.0 0	14	2.3 0	30.6 1	-	-
东 方 证 券	202306260003 1006	光 启 技 术	202 3 年 06 月 26 日	29,520. 00	2,000.0 0	14	1.6 0	18.3 7	30,520. 00	5.25
东 方 证 券	202306260003 1008	华 天 科	202 3 年	18,300. 00	2,000.0 0	14	1.8 0	12.8 1	18,400. 00	3.66

券		技	06 月 26 日							
东方证 券	202306260003 1116	兆 驰 股 份	202 3 年 06 月 26 日	11,020. 00	2,000.0 0	14	1.8 0	7.71	11,000. 00	2.20
东方证 券	202306260003 1406	中 信 重 工	202 3 年 06 月 26 日	3,990.0 0	1,000.0 0	14	1.0 0	1.55	4,210.0 0	0.44
东方证 券	202306260003 1542	昆 仑 万 维	202 3 年 06 月 26 日	87,820. 00	2,000.0 0	14	2.5 0	85.3 8	80,560. 00	24.3 9
东方证 券	202306260003 1614	中 国 海 防	202 3 年 06 月 26 日	26,050. 00	1,000.0 0	14	1.8 0	18.2 4	27,220. 00	5.21
东方证 券	202306260003 1714	海 信 视 像	202 3 年 06 月 26 日	44,920. 00	2,000.0 0	14	1.4 0	24.4 6	49,500. 00	6.99
东方证 券	202306260003 1756	申 通 快 递	202 3 年 06 月	11,020. 00	1,000.0 0	14	1.1 0	4.71	10,820. 00	1.35

			26 日							
东方 证券	202306260003 1835	中国 西电	202 3 年 06 月 26 日	10,420. 00	2,000.0 0	14	1.6 0	6.48	10,820. 00	1.85
东方 证券	202306260003 1865	东华 软件	202 3 年 06 月 26 日	14,320. 00	2,000.0 0	14	1.9 0	10.5 8	14,120. 00	3.02
东方 证券	202306260003 1995	华西 证券	202 3 年 06 月 26 日	16,000. 00	2,000.0 0	14	1.1 0	6.84	16,620. 00	1.95
东方 证券	202306260003 2078	鲁西 化工	202 3 年 06 月 26 日	20,040. 00	2,000.0 0	14	1.5 0	11.6 9	21,120. 00	3.34
东方 证券	202306260003 2176	中航 高科	202 3 年 06 月 26 日	23,520. 00	1,000.0 0	14	1.3 0	11.8 9	25,310. 00	3.40
东方 证券	202306260003 2346	多氟 多	202 3 年 06 月 26 日	38,140. 00	2,000.0 0	14	1.9 0	28.1 8	39,720. 00	8.05

东方 证券	202306260003 2385	五 矿 资 本	202 3 年 06 月 26 日	10,500. 00	2,000.0 0	14	1.1 0	4.49	10,760. 00	1.28
东方 证券	202306260003 2473	复 旦 微 电	202 3 年 06 月 26 日	53,060. 00	1,000.0 0	14	2.8 0	57.7 8	50,100. 00	16.5 1
东方 证券	202306260003 2582	蓝 色 光 标	202 3 年 06 月 26 日	19,900. 00	2,000.0 0	14	2.2 0	17.0 3	19,340. 00	4.87
东方 证券	202306260003 2583	唐 山 港	202 3 年 06 月 26 日	6,780.0 0	2,000.0 0	14	1.4 0	3.69	7,060.0 0	1.05
东方 证券	202306260003 2697	景 嘉 微	202 3 年 06 月 26 日	89,000. 00	1,000.0 0	14	3.5 0	121. 14	89,990. 00	34.6 1
东方 证券	202306260003 2753	湘 财 股 份	202 3 年 06 月 26 日	14,780. 00	2,000.0 0	14	1.9 0	10.9 2	15,600. 00	3.12
东 方	202306260003 2861	中 材	202 3	39,980. 00	2,000.0 0	14	1.4 0	21.7 7	41,040. 00	6.22

证券		科技	2023年06月26日							
东方证券	2023062600032907	江淮汽车	2023年06月26日	25,080.00	2,000.00	14	1.10	10.73	25,180.00	3.07
东方证券	2023062600032996	中文传媒	2023年06月26日	26,240.00	2,000.00	14	2.30	23.47	26,640.00	6.71
东方证券	2023062600033043	朗新科技	2023年06月26日	47,260.00	2,000.00	14	2.50	45.95	46,560.00	13.13
东方证券	2023062600033077	卫宁健康	2023年06月26日	10,740.00	1,000.00	14	2.20	9.19	10,820.00	2.63
东方证券	2023062600033095	巨化股份	2023年06月26日	26,620.00	2,000.00	14	1.80	18.63	27,560.00	5.32
东方证券	2023062600033426	中银证券	2023年06月26日	20,800.00	2,000.00	14	1.90	15.37	21,320.00	4.39

			月 26 日							
东方 证 券	202306260003 3655	四川 长 虹	202 3 年 06 月 26 日	9,400.0 0	2,000.0 0	14	1.6 0	5.85	10,100. 00	1.67
东方 证 券	202306260003 3687	海 思 科	202 3 年 06 月 26 日	44,480. 00	2,000.0 0	14	1.9 0	32.8 7	47,200. 00	9.39
东方 证 券	202306260003 3906	兴 发 集 团	202 3 年 06 月 26 日	21,690. 00	1,000.0 0	14	1.6 0	13.5 0	22,220. 00	3.86
东方 证 券	202306260003 4014	网 宿 科 技	202 3 年 06 月 26 日	14,520. 00	2,000.0 0	14	2.2 0	12.4 2	14,220. 00	3.55
东方 证 券	202306260003 4146	新 兴 铸 管	202 3 年 06 月 26 日	3,970.0 0	1,000.0 0	14	1.2 0	1.85	4,080.0 0	0.53
东方 证 券	202306260003 4212	江 苏 有 线	202 3 年 06 月 26 日	3,340.0 0	1,000.0 0	14	1.3 0	1.69	3,380.0 0	0.48

			日							
东方证券	202306260003 4259	长川科技	2023年06月26日	94,560.00	2,000.00	14	2.20	80.90	94,980.00	23.11
东方证券	202306260003 4497	抚顺特钢	2023年06月26日	17,820.00	2,000.00	14	1.20	8.32	20,400.00	2.38
东方证券	202306260003 4506	航天信息	2023年06月26日	27,460.00	2,000.00	14	1.30	13.88	27,380.00	3.97
东方证券	202306260003 4588	石基信息	2023年06月26日	28,800.00	2,000.00	14	1.60	17.92	28,000.00	5.12
东方证券	202306260003 4994	索菲亚	2023年06月26日	33,800.00	2,000.00	14	1.70	22.35	34,840.00	6.39
东方证券	202306260003 5045	中国动力	2023年06月26日	41,100.00	2,000.00	14	1.90	30.37	46,880.00	8.68
东	202306260003	上	202	22,180.	2,000.0	14	1.7	14.6	21,540.	4.19

方 证 券	6156	海 电 力	3 年 06 月 26 日	00	0		0	6	00	
东 方 证 券	202306260003 6901	芯 原 股 份	202 3 年 06 月 26 日	159,040 .00	2,000.0 0	14	2.2 0	136. 07	143,840 .00	38.8 8
东 方 证 券	202306260003 7337	华 发 股 份	202 3 年 06 月 26 日	19,180. 00	2,000.0 0	14	1.7 0	12.6 8	19,700. 00	3.62
东 方 证 券	202306260003 7992	物 产 中 大	202 3 年 06 月 26 日	9,520.0 0	2,000.0 0	14	1.0 0	3.70	9,880.0 0	1.06
东 方 证 券	202306260003 8212	中 铁 工 业	202 3 年 06 月 26 日	18,700. 00	2,000.0 0	14	1.1 0	8.00	19,760. 00	2.29
东 方 证 券	202306260003 8389	烽 火 通 信	202 3 年 06 月 26 日	40,780. 00	2,000.0 0	14	1.7 0	26.9 6	40,740. 00	7.70
东 方 证 券	202306260003 8630	辽 港 股	202 3 年	193,750 .00	125,000 .00	14	2.4 0	180. 83	195,000 .00	51.6 7

券		份	06 月 26 日							
东方 证券	202306260003 8741	永泰 能源	202 3 年 06 月 26 日	2,880.0 0	2,000.0 0	14	1.4 0	1.57	2,840.0 0	0.45
东方 证券	202306260003 9399	新 大 陆	202 3 年 06 月 26 日	37,800. 00	2,000.0 0	14	1.1 0	16.1 7	37,800. 00	4.62
东方 证券	202306260004 0030	石 英 股 份	202 3 年 06 月 26 日	316,050 .00	3,000.0 0	14	2.4 0	294. 98	341,520 .00	84.2 8
招商 证券	202306260004 7372	中 控 技 术	202 3 年 06 月 26 日	63,450. 00	1,000.0 0	14	3.2 0	78.9 6	62,780. 00	22.5 6
上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日										
关 联 方 名 称	合 约 编 号	证 券 名 称	成 交 时 间	交 易 金 额	交 易 数 量 (单 位 : 股)	出 借 期 限 (单 位 : 天)	费 率	利 息 收 入	期 末 证 券 出 借 业 务 余 额	期 末 应 收 利 息 余 额
东	202201110000	微	202	134,082	3,900.0	14	3.6	187.	-	-

方 证 券	0695	芯 生 物	2 年 01 月 11 日	.00	0		0	71		
东 方 证 券	202201110000 0697	圣 湘 生 物	202 2 年 01 月 11 日	66,100. 00	1,000.0 0	14	3.6 0	92.5 4	-	-
东 方 证 券	202201250001 1880	圣 湘 生 物	202 2 年 01 月 25 日	52,310. 00	1,000.0 0	14	3.6 0	73.2 3	-	-
东 方 证 券	202201250001 1890	微 芯 生 物	202 2 年 01 月 25 日	125,307 .00	3,900.0 0	14	3.6 0	175. 43	-	-
东 方 证 券	202202080001 5272	微 芯 生 物	202 2 年 02 月 08 日	117,234 .00	3,900.0 0	14	3.6 0	164. 13	-	-
东 方 证 券	202202080001 5276	圣 湘 生 物	202 2 年 02 月 08 日	51,310. 00	1,000.0 0	14	3.6 0	71.8 3	-	-
东 方 证 券	202202220001 3703	微 芯 生 物	202 2 年	114,855 .00	3,900.0 0	14	3.6 0	160. 80	-	-

券		物	02 月 22 日							
东方证 券	202203070000 1323	三聚环 保	202 2 年 03 月 07 日	7,400.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	9.78	-	-
招商证 券	202203070000 1331	捷成股 份	202 2 年 03 月 07 日	27,888. 00	4,800.0 0	14	4.0 0	43.3 8	-	-
招商证 券	202203070000 1337	碧水源	202 2 年 03 月 07 日	242,298 .00	37,800. 00	14	4.0 0	376. 91	-	-
东方证 券	202203210000 0740	昆仑万 维	202 2 年 03 月 21 日	16,550. 00	1,000.0 0	14	3.4 0	25.0 1	-	-
东方证 券	202203210000 0741	景嘉微	202 2 年 03 月 21 日	108,000 .00	1,000.0 0	14	3.4 0	163. 20	-	-
东方证 券	202203210000 0746	卫宁健 康	202 2 年 03 月	9,600.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	14.5 1	-	-

			21 日							
东方证 券	202203210000 0749	长盈精 密	202 2年 03月 21日	10,530. 00	1,000.0 0	14	3.4 0	15.9 1	-	-
东方证 券	202203210000 0752	中际旭 创	202 2年 03月 21日	33,780. 00	1,000.0 0	14	3.4 0	51.0 5	-	-
东方证 券	202203210000 0754	网宿科 技	202 2年 03月 21日	6,000.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	9.07	-	-
东方证 券	202203210000 0758	国瓷材 料	202 2年 03月 21日	34,250. 00	1,000.0 0	14	3.4 0	51.7 6	-	-
东方证 券	202203210000 0760	信维通 信	202 2年 03月 21日	18,700. 00	1,000.0 0	14	3.4 0	28.2 6	-	-
招商证 券	202203210000 0761	万孚生 物	202 2年 03月 21日	295,434 .00	5,400.0 0	14	4.0 0	525. 22	-	-

东方 证券	202203210000 0762	利亚德	2022 年 03 月 21 日	7,540.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	11.3 9	-	-
东方 证券	202203210000 0764	光线传媒	2022 年 03 月 21 日	8,030.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	12.1 3	-	-
东方 证券	202203210000 0766	普利制药	2022 年 03 月 21 日	44,370. 00	1,000.0 0	14	3.4 0	67.0 5	-	-
东方 证券	202203210000 0769	万达信息	2022 年 03 月 21 日	11,260. 00	1,000.0 0	14	3.4 0	17.0 2	-	-
东方 证券	202203210002 8897	三聚环保	2022 年 03 月 21 日	6,680.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	10.0 9	-	-
招商 证券	202203210003 3221	碧水源	2022 年 03 月 21 日	224,910 .00	37,800. 00	14	4.0 0	399. 84	-	-
招商	202203280000 0336	康泰	2022	71,694. 00	2,100.0 0	14	3.6 0	100. 37	-	-

证券		医学	年 03 月 28 日							
招商 证券	202203280000 0338	碧水源	202 2 年 03 月 28 日	6,435.0 0	1,100.0 0	14	3.6 0	9.01	-	-
东方 证券	202204060005 2283	三聚环 保	202 2 年 04 月 06 日	6,540.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	8.65	-	-
东方 证券	202204060006 0261	景嘉微	202 2 年 04 月 06 日	92,270. 00	1,000.0 0	14	3.4 0	122. 00	-	-
东方 证券	202204060006 0267	普利制 药	202 2 年 04 月 06 日	43,210. 00	1,000.0 0	14	3.4 0	57.1 3	-	-
东方 证券	202204060006 0271	万达信 息	202 2 年 04 月 06 日	10,750. 00	1,000.0 0	14	3.4 0	14.2 1	-	-
东方 证券	202204060006 0273	卫宁健 康	202 2 年 04	9,510.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	12.5 7	-	-

			月 06 日							
东方 证 券	202204060006 0277	昆 仑 万 维	202 2 年 04 月 06 日	17,420. 00	1,000.0 0	14	3.4 0	23.0 3	-	-
东方 证 券	202204060006 0283	国 瓷 材 料	202 2 年 04 月 06 日	34,710. 00	1,000.0 0	14	3.4 0	45.8 9	-	-
东方 证 券	202204060006 0289	长 盈 精 密	202 2 年 04 月 06 日	9,670.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	12.7 9	-	-
东方 证 券	202204060006 0295	网 宿 科 技	202 2 年 04 月 06 日	5,920.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	7.83	-	-
东方 证 券	202204060006 0299	光 线 传 媒	202 2 年 04 月 06 日	8,200.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	10.8 4	-	-
招商 证 券	202204060006 0863	碧 水 源	202 2 年 04 月 06 日	229,824 .00	37,800. 00	14	4.0 0	357. 50	-	-

			日							
招商证券	2022040600060867	万孚生物	2022年04月06日	265,356.00	5,400.00	14	4.00	412.78	-	-
东方证券	2022040600066187	信维通信	2022年04月06日	17,710.00	1,000.00	14	3.40	23.42	-	-
东方证券	2022040600066201	利亚德	2022年04月06日	7,150.00	1,000.00	14	3.40	9.45	-	-
东方证券	2022040600066203	中际旭创	2022年04月06日	30,100.00	1,000.00	14	3.40	39.80	-	-
招商证券	2022041100000849	万达信息	2022年04月11日	190,617.00	20,300.00	14	3.60	266.86	-	-
东方证券	2022042000043090	中际旭创	2022年04月20日	29,930.00	1,000.00	14	3.40	42.40	-	-
东	202204200004	景	202	87,100.	1,000.0	14	3.4	123.	-	-

方 证 券	3118	嘉 微	2 年 04 月 20 日	00	0		0	39		
东 方 证 券	202204200004 3120	万 达 信 息	202 2 年 04 月 20 日	9,320.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	13.2 0	-	-
东 方 证 券	202204200004 3124	卫 宁 健 康	202 2 年 04 月 20 日	8,130.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	11.5 2	-	-
东 方 证 券	202204200004 3130	利 亚 德	202 2 年 04 月 20 日	6,610.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	9.36	-	-
东 方 证 券	202204200004 3766	昆 仑 万 维	202 2 年 04 月 20 日	15,030. 00	1,000.0 0	14	3.4 0	21.2 9	-	-
东 方 证 券	202204200004 5002	三 聚 环 保	202 2 年 04 月 20 日	5,900.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	8.36	-	-
东 方 证 券	202204200004 5008	光 线 传	202 2 年	8,000.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	11.3 3	-	-

券		媒	04 月 20 日							
东方 证券	202204200004 5012	网 宿 科 技	202 2 年 04 月 20 日	5,380.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	7.62	-	-
东方 证券	202204200004 5016	国 瓷 材 料	202 2 年 04 月 20 日	32,120. 00	1,000.0 0	14	3.4 0	45.5 0	-	-
东方 证券	202204200004 5020	信 维 通 信	202 2 年 04 月 20 日	16,070. 00	1,000.0 0	14	3.4 0	22.7 7	-	-
东方 证券	202204200004 5022	长 盈 精 密	202 2 年 04 月 20 日	8,460.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	11.9 9	-	-
东方 证券	202204200004 5036	普 利 制 药	202 2 年 04 月 20 日	27,710. 00	1,000.0 0	14	3.4 0	39.2 6	-	-
招商 证券	202204200004 5168	万 孚 生 物	202 2 年 04 月	245,160 .00	5,400.0 0	14	4.0 0	408. 60	-	-

			20 日							
招商 证券	202204200004 6942	碧 水 源	202 2 年 04 月 20 日	193,914 .00	37,800. 00	14	4.0 0	323. 19	-	-
东 方 证 券	202204250000 0572	碧 水 源	202 2 年 04 月 25 日	9,260.0 0	2,000.0 0	14	3.4 0	12.2 4	-	-
招 商 证 券	202204250000 6017	万 达 信 息	202 2 年 04 月 25 日	159,558 .00	20,300. 00	14	3.6 0	223. 38	-	-
东 方 证 券	202205050006 3195	中 际 旭 创	202 2 年 05 月 05 日	31,910. 00	1,000.0 0	14	3.4 0	42.1 9	-	-
东 方 证 券	202205050006 3203	万 达 信 息	202 2 年 05 月 05 日	8,180.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	10.8 2	-	-
东 方 证 券	202205050006 3207	景 嘉 微	202 2 年 05 月 05 日	83,050. 00	1,000.0 0	14	3.4 0	109. 81	-	-

东方 证 券	202205050006 3209	利 亚 德	202 2 年 05 月 05 日	6,000.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	7.93	-	-
东方 证 券	202205050006 3217	昆 仑 万 维	202 2 年 05 月 05 日	14,570. 00	1,000.0 0	14	3.4 0	19.2 6	-	-
东方 证 券	202205050006 3225	光 线 传 媒	202 2 年 05 月 05 日	7,000.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	9.26	-	-
东方 证 券	202205050006 3231	卫 宁 健 康	202 2 年 05 月 05 日	8,090.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	10.7 0	-	-
东方 证 券	202205050006 4463	普 利 制 药	202 2 年 05 月 05 日	26,740. 00	1,000.0 0	14	3.4 0	35.3 6	-	-
东方 证 券	202205050006 4483	网 宿 科 技	202 2 年 05 月 05 日	4,830.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	6.39	-	-
东 方	202205050006 4493	三 聚	202 2	4,250.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	5.62	-	-

证券		环保	年 05 月 05 日							
东方 证券	202205050006 4507	国 瓷 材 料	202 2 年 05 月 05 日	32,290. 00	1,000.0 0	14	3.4 0	42.6 9	-	-
招商 证券	202205050006 4877	碧 水 源	202 2 年 05 月 05 日	175,014 .00	37,800. 00	14	4.0 0	272. 24	-	-
招商 证券	202205050006 4887	万 孚 生 物	202 2 年 05 月 05 日	246,402 .00	5,400.0 0	14	4.0 0	383. 29	-	-
东方 证券	202205050007 3435	信 维 通 信	202 2 年 05 月 05 日	14,960. 00	1,000.0 0	14	3.4 0	19.7 8	-	-
东方 证券	202205050007 3437	长 盈 精 密	202 2 年 05 月 05 日	7,760.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	10.2 6	-	-
东方 证券	202205090000 0754	迈 为 股 份	202 2 年 05	485,400 .00	1,500.0 0	14	3.4 0	641. 81	-	-

			月 09 日							
东方 证券	202205090000 0756	景 嘉 微	202 2 年 05 月 09 日	154,422 .00	1,800.0 0	14	3.4 0	204. 18	-	-
东方 证券	202205090000 0762	利 亚 德	202 2 年 05 月 09 日	11,800. 00	2,000.0 0	14	3.4 0	15.6 0	-	-
东方 证券	202205090000 0764	昆 仑 万 维	202 2 年 05 月 09 日	28,640. 00	2,000.0 0	14	3.4 0	37.8 7	-	-
东方 证券	202205090000 0766	信 维 通 信	202 2 年 05 月 09 日	29,800. 00	2,000.0 0	14	3.4 0	39.4 0	-	-
东方 证券	202205090000 0770	长 盈 精 密	202 2 年 05 月 09 日	14,940. 00	2,000.0 0	14	3.4 0	19.7 5	-	-
东方 证券	202205090000 0772	长 信 科 技	202 2 年 05 月 09 日	11,820. 00	2,000.0 0	14	3.4 0	15.6 3	-	-

			日							
东方证券	2022050900000774	国瓷材料	2022年05月09日	62,800.00	2,000.00	14	3.40	83.04	-	-
东方证券	2022050900000776	卫宁健康	2022年05月09日	16,180.00	2,000.00	14	3.40	21.39	-	-
东方证券	2022050900000778	光线传媒	2022年05月09日	13,680.00	2,000.00	14	3.40	18.09	-	-
东方证券	20220509000010249	碧水源	2022年05月09日	9,340.00	2,000.00	14	3.40	12.35	-	-
东方证券	20220519000041549	三聚环保	2022年05月19日	4,650.00	1,000.00	14	3.40	6.15	-	-
东方证券	20220519000041555	网宿科技	2022年05月19日	5,120.00	1,000.00	14	3.40	6.77	-	-
东	2022051900004	光	202	7,120.0	1,000.0	14	3.4	9.41	-	-

方 证 券	1561	线 传 媒	2 年 05 月 19 日	0	0		0			
东 方 证 券	202205190004 3657	景 嘉 微	202 2 年 05 月 19 日	91,650. 00	1,000.0 0	14	3.4 0	121. 18	-	-
东 方 证 券	202205190004 3671	中 际 旭 创	202 2 年 05 月 19 日	31,180. 00	1,000.0 0	14	3.4 0	41.2 3	-	-
东 方 证 券	202205190004 3691	卫 宁 健 康	202 2 年 05 月 19 日	8,270.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	10.9 3	-	-
东 方 证 券	202205190004 3697	昆 仑 万 维	202 2 年 05 月 19 日	14,720. 00	1,000.0 0	14	3.4 0	19.4 6	-	-
东 方 证 券	202205190004 3709	信 维 通 信	202 2 年 05 月 19 日	15,590. 00	1,000.0 0	14	3.4 0	20.6 1	-	-
东 方 证 券	202205190004 4045	利 亚 德	202 2 年	6,170.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	8.16	-	-

券			05 月 19 日							
东方 证 券	202205190004 4051	普 利 制 药	202 2 年 05 月 19 日	26,920. 00	1,000.0 0	14	3.4 0	35.5 9	-	-
东方 证 券	202205190004 4057	长 盈 精 密	202 2 年 05 月 19 日	8,470.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	11.2 0	-	-
东方 证 券	202205190004 4071	国 瓷 材 料	202 2 年 05 月 19 日	33,180. 00	1,000.0 0	14	3.4 0	43.8 7	-	-
招 商 证 券	202205190004 4425	碧 水 源	202 2 年 05 月 19 日	181,440 .00	37,800. 00	14	4.0 0	282. 24	-	-
招 商 证 券	202205190004 5015	万 孚 生 物	202 2 年 05 月 19 日	220,914 .00	5,400.0 0	14	4.0 0	343. 64	-	-
东 方 证 券	202205230000 0619	中 际 旭 创	202 2 年 05 月	62,960. 00	2,000.0 0	14	3.4 0	83.2 5	-	-

			23 日							
东方 证券	202205230000 6783	光线 传媒	202 2 年 05 月 23 日	14,840. 00	2,000.0 0	14	3.4 0	19.6 2	-	-
东方 证券	202205230000 6801	碧水 源	202 2 年 05 月 23 日	9,780.0 0	2,000.0 0	14	3.4 0	12.9 3	-	-
东方 证券	202205230000 6817	长信 科技	202 2 年 05 月 23 日	13,560. 00	2,000.0 0	14	3.4 0	17.9 3	-	-
东方 证券	202205230000 6843	利亚 德	202 2 年 05 月 23 日	12,520. 00	2,000.0 0	14	3.4 0	16.5 5	-	-
东方 证券	202205230000 6849	长盈 精密	202 2 年 05 月 23 日	17,160. 00	2,000.0 0	14	3.4 0	22.6 9	-	-
东方 证券	202205230000 6855	迈为 股份	202 2 年 05 月 23 日	562,200 .00	1,500.0 0	14	3.4 0	743. 35	-	-

东方 证券	202205230000 6865	昆 仑 万 维	202 2 年 05 月 23 日	30,000. 00	2,000.0 0	14	3.4 0	39.6 7	-	-
东方 证券	202205230000 6869	国 瓷 材 料	202 2 年 05 月 23 日	66,740. 00	2,000.0 0	14	3.4 0	88.2 5	-	-
东方 证券	202205230000 6929	景 嘉 微	202 2 年 05 月 23 日	165,672 .00	1,800.0 0	14	3.4 0	219. 06	-	-
东方 证券	202205230000 6945	卫 宁 健 康	202 2 年 05 月 23 日	17,340. 00	2,000.0 0	14	3.4 0	22.9 3	-	-
东方 证券	202205230000 6953	信 维 通 信	202 2 年 05 月 23 日	31,540. 00	2,000.0 0	14	3.4 0	41.7 0	-	-
东方 证券	202206130000 3376	万 孚 生 物	202 2 年 06 月 13 日	80,100. 00	2,000.0 0	14	3.4 0	105. 91	-	-
东 方	202206130000 3378	中 际	202 2	65,600. 00	2,000.0 0	14	3.4 0	86.7 4	-	-

证 券		旭 创	年 06 月 13 日							
东 方 证 券	202206130000 3380	开 山 股 份	202 2 年 06 月 13 日	29,340. 00	2,000.0 0	14	3.4 0	38.7 9	-	-
东 方 证 券	202206130000 3382	易 华 录	202 2 年 06 月 13 日	33,480. 00	2,000.0 0	14	3.4 0	44.2 7	-	-
东 方 证 券	202206130000 3384	万 达 信 息	202 2 年 06 月 13 日	18,160. 00	2,000.0 0	14	3.4 0	24.0 1	-	-
东 方 证 券	202206130000 3386	三 聚 环 保	202 2 年 06 月 13 日	9,520.0 0	2,000.0 0	14	3.4 0	12.5 9	-	-
东 方 证 券	202206130000 3390	机 器 人	202 2 年 06 月 13 日	16,940. 00	2,000.0 0	14	3.4 0	22.4 0	-	-
东 方 证 券	202206130000 3392	网 宿 科 技	202 2 年 06	10,360. 00	2,000.0 0	14	3.4 0	13.7 0	-	-

			月 13 日							
东方 证券	202206130000 3394	华 测 检 测	202 2 年 06 月 13 日	44,940. 00	2,000.0 0	14	3.4 0	59.4 2	-	-
东方 证券	202206130000 3396	稳 健 医 疗	202 2 年 06 月 13 日	64,780. 00	1,000.0 0	14	3.4 0	85.6 5	-	-
东方 证券	202206130000 3398	光 威 复 材	202 2 年 06 月 13 日	113,580 .00	2,000.0 0	14	3.4 0	150. 18	-	-
东方 证券	202206200000 1462	机 器 人	202 2 年 06 月 20 日	18,100. 00	2,000.0 0	14	3.4 0	23.9 3	20,160. 00	17.0 9
东方 证券	202206200000 1464	易 华 录	202 2 年 06 月 20 日	32,414. 00	1,900.0 0	14	3.4 0	42.8 6	33,060. 00	30.6 1
东方 证券	202206200000 1466	网 宿 科 技	202 2 年 06 月 20 日	10,640. 00	2,000.0 0	14	3.4 0	14.0 7	10,720. 00	10.0 5

			日							
东方证券	202206200000 1468	华测检测	2022年06月20日	44,400.00	2,000.00	14	3.40	58.71	46,420.00	41.94
东方证券	202206200000 1470	稳健医疗	2022年06月20日	83,239.00	1,300.00	14	3.40	110.06	86,450.00	78.61
东方证券	202206200000 1472	中际旭创	2022年06月20日	64,740.00	2,000.00	14	3.40	85.60	62,100.00	61.14
东方证券	202206200000 1474	光威复材	2022年06月20日	111,260.00	2,000.00	14	3.40	147.11	117,740.00	105.08
东方证券	202206270000 1198	中际旭创	2022年06月27日	62,000.00	2,000.00	14	3.40	81.98	62,100.00	17.57
东方证券	202206270000 1208	华测检测	2022年06月27日	46,640.00	2,000.00	14	3.40	61.67	46,420.00	13.22
东	202206270000	光	202	91,360.	1,600.0	14	3.4	120.	94,192.	25.8

方 证 券	1210	威 复 材	2 年 06 月 27 日	00	0		0	80	00	9
东 方 证 券	202206270001 4230	万 达 信 息	202 2 年 06 月 27 日	18,300. 00	2,000.0 0	14	3.4 0	24.2 0	18,880. 00	5.19
东 方 证 券	202206270001 4232	万 孚 生 物	202 2 年 06 月 27 日	81,600. 00	2,000.0 0	14	3.4 0	107. 89	81,420. 00	23.1 2
东 方 证 券	202206270001 4234	中 际 旭 创	202 2 年 06 月 27 日	62,000. 00	2,000.0 0	14	3.4 0	81.9 8	62,100. 00	17.5 7
东 方 证 券	202206270001 4236	开 山 股 份	202 2 年 06 月 27 日	29,580. 00	2,000.0 0	14	3.4 0	39.1 1	29,920. 00	8.38
东 方 证 券	202206270001 4352	三 聚 环 保	202 2 年 06 月 27 日	10,160. 00	2,000.0 0	14	3.4 0	13.4 3	10,120. 00	2.88
东 方 证 券	202206270001 4354	网 宿 科	202 2 年	10,640. 00	2,000.0 0	14	3.4 0	14.0 7	10,720. 00	3.02

券		技	06 月 27 日							
东方 证券	202206270001 4360	华 测 检 测	202 2 年 06 月 27 日	46,640. 00	2,000.0 0	14	3.4 0	61.6 7	46,420. 00	13.2 2
东方 证券	202206270001 4364	稳 健 医 疗	202 2 年 06 月 27 日	64,960. 00	1,000.0 0	14	3.4 0	85.8 9	66,500. 00	18.4 1
东方 证券	202206270001 4368	光 威 复 材	202 2 年 06 月 27 日	114,200 .00	2,000.0 0	14	3.4 0	151. 00	117,740 .00	32.3 6
东方 证券	202206270001 4376	易 华 录	202 2 年 06 月 27 日	34,560. 00	2,000.0 0	14	3.4 0	45.7 0	34,800. 00	9.79

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自有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

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

注：本基金本报告期末及上年度末均无由关联方保管的银行存款余额，本报告期及上年度可

比期间均未有由关联方保管银行存款而产生的利息收入。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注:本基金本报告期未进行利润分配。于资产负债表日之后、财务报表批准日之前批准、公告或实施的利润分配情况详见资产负债表日后事项章节。

6.4.12 期末 (2023 年 06 月 30 日) 本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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05月15日	6个月	新股流通受限	27.93	33.03	82	2,290.26	2,708.46	
300804	广康生化	2023年06月15日	6个月	新股流通受限	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	
301170	锡南科技	2023年06月16日	6个月	新股流通受限	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	
301202	朗	2023	5	新	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	

	威股份	年 06 月 28 日	个 交 易 日	股 流 通 受 限						
301202	朗威股份	2023 年 06 月 28 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	
301225	恒勃股份	2023 年 06 月 08 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	
301232	飞沃科技	2023 年 06 月 08 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	
301261	恒工精密	2023 年 06 月 29 日	7 个 交 易 日	新 股 流 通 受 限	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	
301261	恒工精密	2023 年 06 月 29 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	
301262	海看股份	2023 年 06 月 13 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	30.22	25.50	374	11,302.28	9,537.00	
301292	海科新	2023 年 06 月	6 个 交	新 股 流	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	

	源	月 29 日	易 日	通 受 限						
301292	海科 新源	2023 年 06 月 29 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	
301310	鑫 宏 业	2023 年 05 月 26 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	67.28	65.43	345	23,211.60	22,573.35	
301315	威 士 顿	2023 年 06 月 13 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	
301320	豪 江 智 能	2023 年 06 月 01 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	
301337	亚 华 电 子	2023 年 05 月 16 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	
301355	南 王 科 技	2023 年 06 月 02 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	
301376	致 欧 科 技	2023 年 06 月 14	6 个 月	新 股 流 通 受	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	

		日		限						
301383	天 键 股 份	2023 年 05 月 31 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	46.16	35.72	406	18,740.96	14,502.32	
301397	溯 联 股 份	2023 年 06 月 15 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	53.27	40.20	284	15,128.68	11,416.80	
301399	英 特 科 技	2023 年 05 月 16 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	
301488	豪 恩 汽 电	2023 年 06 月 26 日	6 个 交 易 日	新 股 流 通 受 限	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	
301488	豪 恩 汽 电	2023 年 06 月 26 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	
688334	西 高 院	2023 年 06 月 09 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	14.16	16.21	865	12,248.40	14,021.65	
688361	中 科 飞 测	2023 年 05 月 12 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	23.60	64.67	333	7,858.80	21,535.11	
688443	智	2023	6	新	37.88	29.49	728	27,576.64	21,468.72	

	翔金泰	年 06 月 13 日	个 月	股 流 通 受 限						
688458	美芯晟科技	2023 年 05 月 15 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	75.00	90.76	161	12,075.00	14,612.36	
688472	阿特斯阳光电力	2023 年 06 月 02 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	11.10	17.04	1,433	15,906.30	24,418.32	
688523	航天环宇科技	2023 年 05 月 26 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	
688562	航天软件股份	2023 年 05 月 15 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	
688581	安杰思医学	2023 年 05 月 12 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	125.80	118.03	71	8,931.80	8,380.13	
688582	芯动联科	2023 年 06 月 21 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	26.74	40.68	467	12,487.58	18,997.56	
688620	安凯	2023 年	6 个	新 股	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	

	微电子	06月15日	月	流通受限						
688623	双元科技	2023年05月31日	6个月	新股流通受限	125.88	86.79	103	12,965.64	8,939.37	
688629	四川华丰科技	2023年06月16日	6个月	新股流通受限	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	
688631	莱斯信息	2023年06月19日	6个月	新股流通受限	25.28	29.87	326	8,241.28	9,737.62	

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
					-	-	-	-	-	

6.4.12.1.3 受限证券类别：资产支持证券

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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
					-	-	-	-	-	

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	停牌日期	停牌	期末估值	复牌日期	复牌开盘	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注

	名称		原因	单价		单价				
601298	青岛港	2023年06月28日	重大事件停牌	6.97	2023年07月03日	7.40	38,900	230,670.99	271,133.00	

注：截止 2023 年 6 月 30 日，本基金合计持有*ST 中天（000540.SZ）283,500 股。于 2023 年 6 月 29 日，*ST 中天（000540.SZ）发布公告，深圳证券交易所宣布，自 2023 年 6 月 30 日上午 9 时起，该公司股份的上市地位将按照除牌程序予以取消。为维护基金持有人利益，根据中国证监会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、中国证券业协会基金估值工作小组《关于停牌股票估值的参考方法》的规定，依据中天金融集团股份有限公司公开披露的信息，汇添富基金管理股份有限公司与基金托管人协商一致，将汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）所持有*ST 中天（000540.SZ）按每股 0.01 元人民币估值。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2023 年 06 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2023 年 06 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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：张）	期末估值总额
1	300308	中际旭创	2023年07月10日	2023年07月13日	147.45	10,600	1,562,970.00
2	688256	寒	2023	- 2023	188.00	3,500	658,000.00

		武 纪 科 技	年 07 月 03 日	年 07 月 03 日			
3	600372	中 航 电 子	2023 年 07 月 03 日	- 2023 年 07 月 13 日	15.18	37,300	566,214.00
4	600157	永 泰 能 源	2023 年 07 月 03 日	- 2023 年 07 月 10 日	1.42	369,000	523,980.00
5	300418	昆 仑 万 维	2023 年 07 月 10 日	- 2023 年 07 月 10 日	40.28	13,000	523,640.00
6	002738	中 矿 资 源	2023 年 07 月 03 日	- 2023 年 07 月 10 日	50.94	9,200	468,648.00
7	002463	沪 电 股 份	2023 年 07 月 10 日	- 2023 年 07 月 10 日	20.94	22,100	462,774.00
8	600536	中 国 软 件	2023 年 07 月 03 日	- 2023 年 07 月 03 日	46.88	9,700	454,736.00
9	000066	中 国 长 城	2023 年 07 月 10 日	- 2023 年 07 月 10 日	13.83	32,000	442,560.00
10	600482	中 国 动 力	2023 年 07 月 03 日	- 2023 年 07 月 10 日	23.44	16,700	391,448.00
11	600415	小 商 品 城	2023 年 07 月 10 日	- 2023 年 07 月 10 日	8.53	45,000	383,850.00
12	600489	中 金 黄 金	2023 年 07 月 03 日	- 2023 年 07 月 03 日	10.33	36,500	377,045.00

13	002008	大族激光	2023年07月10日	-	2023年07月10日	26.20	14,000	366,800.00
14	300058	蓝色光标	2023年07月03日	-	2023年07月10日	9.67	37,400	361,658.00
15	002223	鱼跃医疗	2023年07月03日	-	2023年07月03日	35.99	10,000	359,900.00
16	002624	完美世界	2023年07月03日	-	2023年07月10日	16.89	21,000	354,690.00
17	002407	多氟多	2023年07月03日	-	2023年07月10日	19.86	17,800	353,508.00
18	603688	石英股份	2023年07月10日	-	2023年07月10日	113.84	3,000	341,520.00
19	300024	机器人	2023年07月03日	-	2023年07月10日	16.67	20,400	340,068.00
20	688777	中控技术	2023年07月10日	-	2023年07月10日	62.78	5,400	339,012.00
21	688099	晶晨半导体	2023年07月03日	-	2023年07月10日	84.32	4,000	337,280.00
22	601966	玲珑轮胎	2023年07月03日	-	2023年07月03日	22.22	15,000	333,300.00
23	601233	桐昆股	2023年07月03日	-	2023年07月03日	13.25	24,900	329,925.00

		份	日	日				
24	603596	伯特利	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	79.26	4,100	324,966.00
25	300390	天华新能	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 03 日	35.80	9,000	322,200.00
26	300136	信维通信	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 03 日	20.08	16,000	321,280.00
27	002465	海格通信	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 10 日	10.34	29,800	308,132.00
28	600879	航天电子	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	8.49	36,000	305,640.00
29	000021	深科技	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 10 日	19.99	15,200	303,848.00
30	600839	四川长虹	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 10 日	5.05	59,500	300,475.00
31	000629	钒钛股份	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 13 日	3.91	76,300	298,333.00
32	300395	菲利华	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	49.20	6,000	295,200.00
33	300832	新产业	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	59.00	5,000	295,000.00
34	605358	立昂微	2023 年 07 月 03	-	2023 年 07 月 03	36.73	8,000	293,840.00

			日	日				
35	603000	人民 网	2023 年 07 月 04 日	-	2023 年 07 月 04 日	29.20	10,000	292,000.00
36	002409	雅 克 科 技	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	72.88	4,000	291,520.00
37	600177	雅 戈 尔	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	6.31	46,100	290,891.00
38	600516	方 大 炭 素	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 13 日	6.20	46,800	290,160.00
39	600118	中 国 卫 星	2023 年 07 月 13 日	-	2023 年 07 月 13 日	28.21	10,200	287,742.00
40	300118	东 方 日 升	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	25.63	11,000	281,930.00
41	000998	隆 平 高 科	2023 年 07 月 13 日	-	2023 年 07 月 13 日	15.35	18,200	279,370.00
42	300699	光 威 复 材	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	30.85	9,000	277,650.00
43	002195	二 三 四 五	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	2.89	93,900	271,371.00
44	300474	景 嘉 微	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	89.99	3,000	269,970.00
45	000933	神 火 股	2023 年 07 月 03	-	2023 年 07 月 03	13.00	20,700	269,100.00

		份	日	日				
46	300383	光 环 新 网	2023 年 07 月 13 日	-	2023 年 07 月 13 日	10.75	24,900	267,675.00
47	000831	中 国 稀 土	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	29.60	9,000	266,400.00
48	002850	科 达 利	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	132.25	2,000	264,500.00
49	002368	太 极 股 份	2023 年 07 月 13 日	-	2023 年 07 月 13 日	41.17	6,400	263,488.00
50	002739	万 达 电 影	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	12.54	21,000	263,340.00
51	002281	光 迅 科 技	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 03 日	37.09	7,100	263,339.00
52	300088	长 信 科 技	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 10 日	6.03	43,500	262,305.00
53	000519	中 兵 红 箭	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 03 日	18.09	14,400	260,496.00
54	002353	杰 瑞 股 份	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 10 日	25.13	10,000	251,300.00
55	002268	电 科 网 安	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 03 日	27.87	9,000	250,830.00
56	601997	贵 阳 银	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	5.16	48,600	250,776.00

		行	日	日			
57	600499	科达制造	2023年07月10日	2023年07月10日	11.36	22,000	249,920.00
58	000960	锡业股份	2023年07月03日	2023年07月10日	15.55	16,000	248,800.00
59	002203	海亮股份	2023年07月13日	2023年07月13日	12.01	20,300	243,803.00
60	600498	烽火通信	2023年07月03日	2023年07月10日	20.37	11,800	240,366.00
61	300438	鹏辉能源	2023年07月10日	2023年07月10日	48.04	5,000	240,200.00
62	688220	翱捷科技	2023年07月10日	2023年07月10日	75.39	3,100	233,709.00
63	300182	捷成股份	2023年07月03日	2023年07月03日	6.31	36,800	232,208.00
64	603927	中科软	2023年07月13日	2023年07月13日	38.56	6,000	231,360.00
65	601016	节能风电	2023年07月03日	2023年07月10日	3.67	63,000	231,210.00
66	300017	网宿科技	2023年07月03日	2023年07月10日	7.11	32,500	231,075.00
67	603517	绝味食	2023年07月03日	2023年07月03日	37.15	6,200	230,330.00

		品	日	日			
68	600705	中航产融	2023年07月03日	2023年07月03日	3.83	59,400	227,502.00
69	002506	协鑫集成	2023年07月03日	2023年07月10日	2.93	76,800	225,024.00
70	000060	中金岭南	2023年07月10日	2023年07月10日	4.75	46,800	222,300.00
71	002092	中泰化学	2023年07月03日	2023年07月03日	6.45	34,000	219,300.00
72	000591	太阳能	2023年07月03日	2023年07月13日	6.78	32,200	218,316.00
73	600258	首旅酒店	2023年07月13日	2023年07月13日	18.95	11,500	217,925.00
74	002531	天顺风能	2023年07月03日	2023年07月10日	15.23	14,000	213,220.00
75	000970	中科三环	2023年07月03日	2023年07月03日	12.82	16,400	210,248.00
76	600008	首创环保	2023年07月03日	2023年07月03日	2.88	73,000	210,240.00
77	688385	复旦微电	2023年07月10日	2023年07月10日	50.10	4,000	200,400.00
78	688390	固德威	2023年07月13日	2023年07月13日	166.86	1,200	200,232.00

		电	日	日				
79	002936	郑 州 银 行	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	2.30	85,800	197,340.00
80	601880	辽 港 股 份	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	1.56	125,000	195,000.00
81	600416	湘 电 股 份	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 10 日	19.09	10,200	194,718.00
82	002244	滨 江 集 团	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	8.82	21,900	193,158.00
83	600580	卧 龙 电 驱	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	14.61	13,000	189,930.00
84	300026	红 日 药 业	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 10 日	5.42	34,900	189,158.00
85	688516	奥 特 维 科 技	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	188.40	1,000	188,400.00
86	601717	郑 煤 机	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 03 日	12.45	15,000	186,750.00
87	300212	易 华 录	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	33.23	5,600	186,088.00
88	689009	九 号 公 司	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	36.85	5,000	184,250.00
89	603127	昭	2023	-	2023	40.90	4,500	184,050.00

		衍 新 药	年 07 月 10 日	年 07 月 10 日			
90	600673	东 阳 光	2023 年 07 月 03 日	- 2023 年 07 月 03 日	7.21	25,000	180,250.00
91	300373	扬 杰 科 技	2023 年 07 月 13 日	- 2023 年 07 月 13 日	40.57	4,400	178,508.00
92	002155	湖 南 黄 金	2023 年 07 月 03 日	- 2023 年 07 月 03 日	12.20	14,400	175,680.00
93	002958	青 农 商 行	2023 年 07 月 03 日	- 2023 年 07 月 03 日	2.72	64,000	174,080.00
94	002128	电 投 能 源	2023 年 07 月 13 日	- 2023 年 07 月 13 日	13.22	13,000	171,860.00
95	000887	中 鼎 股 份	2023 年 07 月 03 日	- 2023 年 07 月 03 日	13.09	13,000	170,170.00
96	000997	新 大 陆	2023 年 07 月 03 日	- 2023 年 07 月 10 日	18.90	9,000	170,100.00
97	002670	国 盛 金 控	2023 年 07 月 10 日	- 2023 年 07 月 10 日	8.78	19,200	168,576.00
98	002444	巨 星 科 技	2023 年 07 月 03 日	- 2023 年 07 月 03 日	21.88	7,700	168,476.00
99	600998	九 州 通	2023 年 07 月 13 日	- 2023 年 07 月 13 日	10.38	16,200	168,156.00
100	600348	华	2023	- 2023	7.91	20,800	164,528.00

		阳 股 份	年 07 月 03 日	年 07 月 03 日			
101	600171	上 海 贝 岭	2023 年 07 月 10 日	- 2023 年 07 月 10 日	18.25	9,000	164,250.00
102	002249	大 洋 电 机	2023 年 07 月 03 日	- 2023 年 07 月 03 日	5.70	28,800	164,160.00
103	600316	洪 都 航 空	2023 年 07 月 10 日	- 2023 年 07 月 10 日	23.45	7,000	164,150.00
104	600959	江 苏 有 线	2023 年 07 月 10 日	- 2023 年 07 月 10 日	3.38	48,200	162,916.00
105	002326	永 太 科 技	2023 年 07 月 13 日	- 2023 年 07 月 13 日	15.29	10,600	162,074.00
106	000400	许 继 电 气	2023 年 07 月 03 日	- 2023 年 07 月 03 日	23.05	7,000	161,350.00
107	300070	碧 水 源	2023 年 07 月 12 日	- 2023 年 07 月 12 日	5.36	30,000	160,800.00
108	600718	东 软 集 团	2023 年 07 月 03 日	- 2023 年 07 月 03 日	10.66	14,800	157,768.00
109	601778	晶 科 科 技	2023 年 07 月 03 日	- 2023 年 07 月 13 日	4.94	31,700	156,598.00
110	300115	长 盈 精 密	2023 年 07 月 10 日	- 2023 年 07 月 10 日	11.91	13,000	154,830.00
111	002487	大	2023	- 2023	30.84	5,000	154,200.00

		金重 工	年 07 月 10 日	年 07 月 10 日			
112	600056	中国 医药	2023 年 07 月 10 日	- 2023 年 07 月 10 日	12.98	11,800	153,164.00
113	601665	齐鲁 银行	2023 年 07 月 10 日	- 2023 年 07 月 10 日	3.92	38,200	149,744.00
114	601098	中南 传媒	2023 年 07 月 03 日	- 2023 年 07 月 10 日	11.60	12,900	149,640.00
115	300251	光线 传媒	2023 年 07 月 03 日	- 2023 年 07 月 10 日	8.09	18,400	148,856.00
116	603568	伟明 环保	2023 年 07 月 10 日	- 2023 年 07 月 10 日	17.51	8,400	147,084.00
117	688521	芯原 微电子	2023 年 07 月 10 日	- 2023 年 07 月 10 日	71.92	2,000	143,840.00
118	000156	华数 传媒	2023 年 07 月 10 日	- 2023 年 07 月 10 日	8.70	16,500	143,550.00
119	300776	帝尔 激光	2023 年 07 月 03 日	- 2023 年 07 月 10 日	64.90	2,200	142,780.00
120	688208	道通 科技	2023 年 07 月 03 日	- 2023 年 07 月 03 日	30.31	4,700	142,457.00
121	000709	河钢 股份	2023 年 07 月 10 日	- 2023 年 07 月 10 日	2.26	61,000	137,860.00

122	000012	南玻 A	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 03 日	5.96	23,000	137,080.00
123	603267	鸿远电子	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	65.30	2,000	130,600.00
124	002791	坚朗五金	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	64.71	2,000	129,420.00
125	002745	木林森	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	9.20	14,000	128,800.00
126	603228	景旺电子	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	25.65	5,000	128,250.00
127	600022	山东钢铁	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	1.42	88,900	126,238.00
128	688276	长春百克生物科技	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	62.60	2,000	125,200.00
129	002131	利欧股份	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 03 日	2.30	53,400	122,820.00
130	601611	中国核建	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 13 日	8.45	14,500	122,525.00
131	688029	南微医学	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	81.56	1,500	122,340.00

		科技					
132	600556	天下秀	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 10 日	7.09	17,200 121,948.00
133	688006	浙江杭可科技	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	30.47	4,000 121,880.00
134	600901	江苏金租	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 03 日	4.13	29,400 121,422.00
135	600339	中油工程	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 03 日	4.07	29,700 120,879.00
136	000559	万向钱潮	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	5.45	22,000 119,900.00
137	002030	达安基因	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 10 日	9.97	11,900 118,643.00
138	600155	华创云信	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 03 日	6.22	19,000 118,180.00
139	000089	深圳机场	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 03 日	6.95	17,000 118,150.00
140	603638	艾迪精密	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 03 日	20.52	5,700 116,964.00
141	000537	广宇发展	2023 年 07 月 04 日	-	2023 年 07 月 04 日	11.67	10,000 116,700.00

142	002156	通富微电	2023年07月13日	-	2023年07月13日	22.60	5,100	115,260.00
143	002505	鹏都农牧	2023年07月10日	-	2023年07月10日	1.89	60,000	113,400.00
144	600373	中文传媒	2023年07月03日	-	2023年07月13日	13.32	8,400	111,888.00
145	600409	三友化工	2023年07月10日	-	2023年07月10日	5.45	20,000	109,000.00
146	601568	北元集团	2023年07月13日	-	2023年07月13日	5.27	20,600	108,562.00
147	002761	浙江建投	2023年07月10日	-	2023年07月10日	15.18	7,000	106,260.00
148	600707	彩虹股份	2023年07月10日	-	2023年07月10日	4.76	22,000	104,720.00
149	601156	东航物流	2023年07月03日	-	2023年07月03日	13.00	8,000	104,000.00
150	688234	天岳先进	2023年07月10日	-	2023年07月10日	73.94	1,400	103,516.00
151	600481	双良节能	2023年07月03日	-	2023年07月03日	13.98	7,300	102,054.00
152	002468	申通快递	2023年07月03日	-	2023年07月10日	10.82	9,400	101,708.00

153	603650	彤程新材	2023年07月10日	-	2023年07月10日	32.80	3,100	101,680.00
154	600985	淮北矿业	2023年07月10日	-	2023年07月10日	11.52	8,800	101,376.00
155	603826	坤彩科技	2023年07月10日	-	2023年07月10日	50.00	2,000	100,000.00
156	688185	康希诺生物	2023年07月03日	-	2023年07月03日	81.50	1,200	97,800.00
157	002925	盈趣科技	2023年07月10日	-	2023年07月10日	19.40	5,000	97,000.00
158	300604	长川科技	2023年07月10日	-	2023年07月10日	47.49	2,000	94,980.00
159	002408	齐翔腾达	2023年07月03日	-	2023年07月03日	6.37	14,800	94,276.00
160	002240	盛新锂能	2023年07月10日	-	2023年07月10日	31.87	2,900	92,423.00
161	688116	天奈科技	2023年07月03日	-	2023年07月03日	45.75	2,000	91,500.00
162	000959	首钢股份	2023年07月10日	-	2023年07月10日	3.50	26,000	91,000.00
163	600871	石化油	2023年07月03日	-	2023年07月03日	1.98	45,600	90,288.00

		服	日	日				
164	000402	金融街	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	4.52	19,900	89,948.00
165	601828	美凯龙	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 03 日	4.79	18,000	86,220.00
166	601298	青岛港	2023 年 06 月 29 日	-	2023 年 06 月 29 日	6.97	12,100	84,337.00
167	300888	稳健医疗	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 03 日	41.67	2,000	83,340.00
168	300850	新强联	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 13 日	37.38	2,200	82,236.00
169	688289	圣湘生物	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 10 日	16.84	4,800	80,832.00
170	600350	山东高速	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 03 日	6.37	12,000	76,440.00
171	603218	日月股份	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 10 日	18.99	4,000	75,960.00
172	601869	长飞光纤	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	37.01	2,000	74,020.00
173	603233	大参林	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 03 日	28.01	2,600	72,826.00
174	600079	人福医药	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 03 日	26.94	2,700	72,738.00

		药	日	日				
175	002653	海思科	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	23.60	3,000	70,800.00
176	603379	三美股份	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	23.51	3,000	70,530.00
177	001872	招商港口	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 03 日	17.27	3,900	67,353.00
178	003035	南网能源	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 03 日	7.12	9,000	64,080.00
179	000553	安道麦 A	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 03 日	8.44	7,400	62,456.00
180	603056	德邦股份	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 03 日	15.42	4,000	61,680.00
181	000027	深圳能源	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	6.59	9,300	61,287.00
182	688105	诺唯赞生物	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	30.49	2,000	60,980.00
183	601718	际华集团	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 03 日	2.97	20,200	59,994.00
184	002532	天山铝业	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	5.99	10,000	59,900.00
185	600208	新湖	2023 年 07	-	2023 年 07	2.48	23,600	58,528.00

		中宝	月 10 日	月 10 日			
186	600704	物产中大	2023 年 07 月 03 日	- 2023 年 07 月 10 日	4.94	11,400	56,316.00
187	600995	南网储能	2023 年 07 月 10 日	- 2023 年 07 月 10 日	11.01	5,000	55,050.00
188	002945	华林证券	2023 年 07 月 03 日	- 2023 年 07 月 03 日	13.68	4,000	54,720.00
189	600764	中国海防	2023 年 07 月 10 日	- 2023 年 07 月 10 日	27.22	2,000	54,440.00
190	601158	重庆水务	2023 年 07 月 10 日	- 2023 年 07 月 10 日	5.56	9,500	52,820.00
191	600060	海信视像	2023 年 07 月 10 日	- 2023 年 07 月 10 日	24.75	2,000	49,500.00
192	603589	口子窖	2023 年 07 月 03 日	- 2023 年 07 月 03 日	49.35	1,000	49,350.00
193	600143	金发科技	2023 年 07 月 03 日	- 2023 年 07 月 03 日	8.73	5,600	48,888.00
194	601198	东兴证券	2023 年 07 月 03 日	- 2023 年 07 月 03 日	8.02	6,000	48,120.00
195	300741	华宝股份	2023 年 07 月 03 日	- 2023 年 07 月 03 日	21.42	2,200	47,124.00
196	300682	朗新	2023 年 07	- 2023 年 07	23.28	2,000	46,560.00

		科 技	月 10 日	月 10 日			
197	600956	新 天 绿 能	2023 年 07 月 04 日	- 2023 年 07 月 04 日	8.72	5,300	46,216.00
198	600032	浙 江 新 能	2023 年 07 月 03 日	- 2023 年 07 月 03 日	12.56	3,500	43,960.00
199	300001	特 锐 德	2023 年 07 月 03 日	- 2023 年 07 月 03 日	20.78	2,100	43,638.00
200	002080	中 材 科 技	2023 年 07 月 10 日	- 2023 年 07 月 10 日	20.52	2,000	41,040.00
201	600535	天 士 力	2023 年 07 月 03 日	- 2023 年 07 月 03 日	14.51	2,700	39,177.00
202	002432	九 安 医 疗	2023 年 07 月 03 日	- 2023 年 07 月 03 日	35.21	1,000	35,210.00
203	002572	索 菲 亚	2023 年 07 月 10 日	- 2023 年 07 月 10 日	17.42	2,000	34,840.00
204	600297	广 汇 汽 车	2023 年 07 月 10 日	- 2023 年 07 月 10 日	2.08	15,700	32,656.00
205	600021	上 海 电 力	2023 年 07 月 10 日	- 2023 年 07 月 10 日	10.77	3,000	32,310.00
206	002625	光 启 技 术	2023 年 07 月 10 日	- 2023 年 07 月 10 日	15.26	2,000	30,520.00
207	600928	西 安	2023 年 07	- 2023 年 07	3.52	8,400	29,568.00

		银行	月 10 日	月 10 日			
208	002153	石基信息	2023 年 07 月 10 日	- 2023 年 07 月 10 日	14.00	2,000	28,000.00
209	600160	巨化股份	2023 年 07 月 10 日	- 2023 年 07 月 10 日	13.78	2,000	27,560.00
210	600271	航天信息	2023 年 07 月 10 日	- 2023 年 07 月 10 日	13.69	2,000	27,380.00
211	603355	莱克电气	2023 年 07 月 10 日	- 2023 年 07 月 10 日	25.41	1,000	25,410.00
212	600862	中航高科	2023 年 07 月 10 日	- 2023 年 07 月 10 日	25.31	1,000	25,310.00
213	600418	江淮汽车	2023 年 07 月 10 日	- 2023 年 07 月 10 日	12.59	2,000	25,180.00
214	600859	王府井	2023 年 07 月 03 日	- 2023 年 07 月 03 日	19.79	1,200	23,748.00
215	600141	兴发集团	2023 年 07 月 10 日	- 2023 年 07 月 10 日	22.22	1,000	22,220.00
216	600827	百联股份	2023 年 07 月 03 日	- 2023 年 07 月 03 日	13.37	1,600	21,392.00
217	603077	和邦生物	2023 年 07 月 10 日	- 2023 年 07 月 10 日	2.43	8,800	21,384.00
218	601696	中银	2023 年 07	- 2023 年 07	10.66	2,000	21,320.00

		证 券	月 10 日	月 10 日			
219	000830	鲁 西 化 工	2023 年 07 月 10 日	- 2023 年 07 月 10 日	10.56	2,000	21,120.00
220	600895	张 江 高 科	2023 年 07 月 03 日	- 2023 年 07 月 03 日	13.92	1,500	20,880.00
221	600399	抚 顺 特 钢	2023 年 07 月 10 日	- 2023 年 07 月 10 日	10.20	2,000	20,400.00
222	600528	中 铁 工 业	2023 年 07 月 10 日	- 2023 年 07 月 10 日	9.88	2,000	19,760.00
223	600325	华 发 股 份	2023 年 07 月 10 日	- 2023 年 07 月 10 日	9.85	2,000	19,700.00
224	300012	华 测 检 测	2023 年 07 月 10 日	- 2023 年 07 月 10 日	19.50	1,000	19,500.00
225	002185	华 天 科 技	2023 年 07 月 10 日	- 2023 年 07 月 10 日	9.20	2,000	18,400.00
226	002497	雅 化 集 团	2023 年 07 月 10 日	- 2023 年 07 月 10 日	17.78	1,000	17,780.00
227	600699	均 胜 电 子	2023 年 07 月 03 日	- 2023 年 07 月 03 日	17.64	1,000	17,640.00
228	002926	华 西 证 券	2023 年 07 月 10 日	- 2023 年 07 月 10 日	8.31	2,000	16,620.00
229	600095	湘 财	2023 年 07	- 2023 年 07	7.80	2,000	15,600.00

		股 份	月 10 日	月 10 日			
230	002065	东 华 软 件	2023 年 07 月 10 日	- 2023 年 07 月 10 日	7.06	2,000	14,120.00
231	002429	兆 驰 股 份	2023 年 07 月 10 日	- 2023 年 07 月 10 日	5.50	2,000	11,000.00
232	601179	中 国 西 电	2023 年 07 月 10 日	- 2023 年 07 月 10 日	5.41	2,000	10,820.00
233	300253	卫 宁 健 康	2023 年 07 月 10 日	- 2023 年 07 月 10 日	10.82	1,000	10,820.00
234	600390	五 矿 资 本	2023 年 07 月 10 日	- 2023 年 07 月 10 日	5.38	2,000	10,760.00
235	002221	东 华 能 源	2023 年 07 月 03 日	- 2023 年 07 月 03 日	8.65	1,000	8,650.00
236	601108	财 通 证 券	2023 年 07 月 03 日	- 2023 年 07 月 03 日	7.24	1,000	7,240.00
237	601000	唐 山 港	2023 年 07 月 10 日	- 2023 年 07 月 10 日	3.53	2,000	7,060.00
238	601118	海 南 橡 胶	2023 年 07 月 10 日	- 2023 年 07 月 10 日	4.48	1,000	4,480.00
239	000958	电 投 产 融	2023 年 07 月 03 日	- 2023 年 07 月 03 日	4.33	1,000	4,330.00
240	601608	中 信	2023 年 07 月 10 日	- 2023 年 07 月 10 日	4.21	1,000	4,210.00

		重 工	月 10 日	月 10 日			
241	000778	新 兴 铸 管	2023 年 07 月 10 日	2023 年 07 月 10 日	4.08	1,000	4,080.00
合计	-	-	-	-	-	4,004,000	39,970,590.00

注：出借证券中如有其它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

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

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外, 本基金本报告期末的其他资产均能及时变现。此外, 本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求, 其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求, 并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求, 对流动性指标进行持续的监测和分析。

本报告期内, 本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和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	1 个月以内	1 -	3 个月-1 年	1 -	5 年	不计息	合计
----	--------	-----	----------	-----	-----	-----	----

末 202 3 年 06 月 30 日		3 个 月		5 年	以 上		
资产							
银行存款	21,111,131.27	-	-	-	-	-	21,111,131.27
结算备付金	4,222,699.79	-	-	-	-	-	4,222,699.79
存出保证金	63,953.14	-	-	-	-	1,002,960.00	1,066,913.14
交易性金融资产	828,039.59	-	3,134,639.37	-	-	380,665,300.96	384,627,979.92
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-

债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	205,640.36	205,640.36
应收股利	-	-	-	-	-	30,024.69	30,024.69
应收申购款	112,342.26	-	-	-	-	469,396.84	581,739.10
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	15,735.03	15,735.03
资产总计	26,338,166.05	-	3,134,639.37	-	-	382,389,057.88	411,861,863.30
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	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	358,672.98	358,672.98
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	168,399.49	168,399.49
应付托管费	-	-	-	-	-	33,679.92	33,679.92
应付销售服	-	-	-	-	-	26,118.02	26,118.02

务费							
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	2,310.15	2,310.15
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	248,911.10	248,911.10
负债总计	-	-	-	-	-	838,091.66	838,091.66
利率敏感度缺口	26,338,166.05	-	3,134,639.37	-	-	381,550,966.22	411,023,771.64
上年度末 2022	1 个月以内	1 - 3 个月	3 个月-1 年	1 - 5 年	5 年以上	不计息	合计

2 年 12 月 31 日							
资产							
银行存款	23,910,410.75	-	-	-	-	-	23,910,410.75
结算备付金	5,793,342.16	-	-	-	-	-	5,793,342.16
存出保证金	22,832.17	-	-	-	-	1,128,883.20	1,151,715.37
交易性金融资产	1,530,314.38	-	2,136,777.04	-	-	393,096,493.34	396,763,584.76
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权	-	-	-	-	-	-	-

投资							
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	116,446.78	-	-	-	-	1,279,298.76	1,395,745.54
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	14,255.12	14,255.12
资产总计	31,373,346.24	-	2,136,777.04	-	-	395,518,930.42	429,029,053.70
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	-	-	-	-	-	13.18	13.18
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,411,087.61	1,411,087.61
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	179,978.11	179,978.11
应付托管费	-	-	-	-	-	35,995.60	35,995.60
应付销售服务费	-	-	-	-	-	30,199.37	30,199.37

应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	1,582.55	1,582.55
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	308,868.98	308,868.98
负债总计	-	-	-	-	-	1,967,725.40	1,967,725.40
利率敏感度缺口	31,373,346.24	-	2,136,777.04	-	-	393,551,205.02	427,061,328.30

表中所示为本基金资产及负债的公允价值,并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况； 2. 该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变； 3. 该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动； 4. 银行活期存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；定期存款利息收入、买入返售金融资产利息收益与卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响； 5. 该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券和可交换债券。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	基准利率减少 25 个基点	2,821.45	2,164.67
	基准利率增加 25 个基点	-2,816.08	-2,160.73

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。

本基金管理人通过标准差、跟踪误差、beta 值等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 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	380,665,300.96	92.61	393,096,493.34	92.05
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	3,962,678.96	0.96	3,667,091.42	0.86
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	384,627,979.92	93.58	396,763,584.76	92.91

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变； 2. 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	中证 500 指数上涨 5%	19,324,006.24	19,945,841.41
	中证 500 指数下跌 5%	-19,324,006.24	-19,945,841.41

注：本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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 06 月 30 日
---------------	-------------------------

第一层次	379,771,856.86
第二层次	4,494,555.81
第三层次	361,567.25
合计	384,627,979.92

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	380,665,300.96	92.43
	其中：股票	380,665,300.96	92.43
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,962,678.96	0.96

	其中：债券	3,962,678.96	0.96
	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	25,333,831.06	6.15
8	其他各项资产	1,900,052.32	0.46
9	合计	411,861,863.30	100.00

注：本基金参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为人民币 39,970,590.00 元，占期末基金资产净值比例 9.72%。

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	2,642,472.00	0.64
B	采矿业	13,885,199.10	3.38
C	制造业	237,172,020.43	57.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,996,764.46	3.16
E	建筑业	4,194,157.00	1.02
F	批发和零售业	11,904,543.33	2.90
G	交通运输、仓储和邮政业	5,678,339.32	1.38
H	住宿和餐饮业	704,940.00	0.17
I	信息传输、软件和信息技术服务业	30,082,283.89	7.32
J	金融业	32,294,241.69	7.86
K	房地产业	5,110,418.00	1.24
L	租赁和商务服务业	4,625,322.00	1.13
M	科学研究和技术服务业	4,247,806.00	1.03
N	水利、环境和公共设施管理业	2,093,294.49	0.51
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,882,789.63	0.46
R	文化、体育和娱乐业	5,326,162.00	1.30
S	综合	1,985,488.80	0.48
	合计	376,826,242.14	91.68

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	3,062,538.89	0.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	98,850.60	0.02
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	519,565.80	0.13
J	金融业	-	-
K	房地产业	4,389.00	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	153,714.53	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,839,058.82	0.93

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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	35,600	5,249,220.00	1.28
2	688256	寒武纪科技	11,527	2,167,076.00	0.53
3	000988	华工科技	55,800	2,120,958.00	0.52
4	002340	格林美	285,000	1,969,350.00	0.48
5	002384	东山精	75,900	1,965,810.00	0.48

		密			
6	002422	科伦药业	65,400	1,941,072.00	0.47
7	600372	中航电子	124,500	1,889,910.00	0.46
8	300418	昆仑万维	46,400	1,868,992.00	0.45
9	601966	玲珑轮胎	82,000	1,822,040.00	0.44
10	300012	华测检测	93,400	1,821,300.00	0.44
11	600157	永泰能源	1,231,700	1,749,014.00	0.43
12	300724	捷佳伟创	15,500	1,741,425.00	0.42
13	600079	人福医药	63,400	1,707,996.00	0.42
14	600489	中金黄金	161,400	1,667,262.00	0.41
15	300003	乐普医疗	73,000	1,650,530.00	0.40
16	688777	中控技术	26,226	1,646,468.28	0.40
17	002738	中矿资源	31,620	1,610,722.80	0.39
18	600487	亨通光电	109,400	1,603,804.00	0.39
19	002028	思源电气	33,977	1,587,405.44	0.39
20	600536	中国软件	33,360	1,563,916.80	0.38
21	601058	赛轮轮胎	135,900	1,547,901.00	0.38
22	002463	沪电股份	73,900	1,547,466.00	0.38
23	601555	东吴证券	222,190	1,541,998.60	0.38
24	600765	中航重机	57,220	1,516,902.20	0.37
25	300037	新宙邦	28,960	1,502,734.40	0.37
26	000066	中国长城	107,300	1,483,959.00	0.36
27	600885	宏发股	46,318	1,475,228.30	0.36

		份			
28	000807	云铝股份	115,400	1,469,042.00	0.36
29	600482	中国动力	59,900	1,404,056.00	0.34
30	000009	中国宝安	114,440	1,381,290.80	0.34
31	688099	晶晨半导体	16,164	1,362,948.48	0.33
32	000423	东阿阿胶	25,400	1,357,630.00	0.33
33	300146	汤臣倍健	56,600	1,357,268.00	0.33
34	600352	浙江龙盛	144,600	1,352,010.00	0.33
35	300058	蓝色光标	138,200	1,336,394.00	0.33
36	002966	苏州银行	203,340	1,331,877.00	0.32
37	002156	通富微电	58,700	1,326,620.00	0.32
38	002185	华天科技	142,400	1,310,080.00	0.32
39	601108	财通证券	180,150	1,304,286.00	0.32
40	600415	小商品城	152,200	1,298,266.00	0.32
41	002625	光启技术	83,800	1,278,788.00	0.31
42	002624	完美世界	75,300	1,271,817.00	0.31
43	600027	华电国际	188,700	1,262,403.00	0.31
44	300144	宋城演艺	101,600	1,259,840.00	0.31
45	600109	国金证券	144,700	1,254,549.00	0.31
46	000783	长江证券	214,800	1,245,840.00	0.30
47	600988	赤峰黄金	92,400	1,243,704.00	0.30
48	600161	天坛生物	45,700	1,240,755.00	0.30

49	601233	桐昆股份	93,600	1,240,200.00	0.30
50	601077	渝农商行	343,500	1,233,165.00	0.30
51	600298	安琪酵母	33,800	1,223,898.00	0.30
52	002008	大族激光	46,700	1,223,540.00	0.30
53	300568	星源材质	71,100	1,222,209.00	0.30
54	300285	国瓷材料	44,600	1,222,040.00	0.30
55	600418	江淮汽车	96,800	1,218,712.00	0.30
56	600096	云天化	71,200	1,215,384.00	0.30
57	002385	大北农	183,900	1,213,740.00	0.30
58	002223	鱼跃医疗	33,400	1,202,066.00	0.29
59	000630	铜陵有色	408,600	1,180,854.00	0.29
60	002407	多氟多	59,420	1,180,081.20	0.29
61	603444	吉比特	2,400	1,178,664.00	0.29
62	600862	中航高科	46,401	1,174,409.31	0.29
63	603882	金域医学	15,500	1,170,250.00	0.28
64	300390	天华新能	32,440	1,161,352.00	0.28
65	002409	雅克科技	15,800	1,151,504.00	0.28
66	300024	机器人	68,900	1,148,563.00	0.28
67	601162	天风证券	385,100	1,147,598.00	0.28
68	603688	石英股份	10,000	1,138,400.00	0.28
69	300474	景嘉微	12,650	1,138,373.50	0.28
70	002497	雅化集团	64,000	1,137,920.00	0.28
71	000933	神火股份	87,300	1,134,900.00	0.28
72	300073	当升科技	22,500	1,132,425.00	0.28
73	002240	盛新锂	35,400	1,128,198.00	0.27

		能			
74	600705	中航产融	294,000	1,126,020.00	0.27
75	300395	菲利华	22,831	1,123,285.20	0.27
76	300604	长川科技	23,600	1,120,764.00	0.27
77	601168	西部矿业	105,700	1,110,907.00	0.27
78	605358	立昂微	30,000	1,101,900.00	0.27
79	002439	启明星辰	37,000	1,101,120.00	0.27
80	000932	华菱钢铁	229,680	1,095,573.60	0.27
81	600066	宇通客车	73,700	1,086,338.00	0.26
82	603596	伯特利	13,700	1,085,862.00	0.26
83	000975	银泰黄金	92,328	1,080,237.60	0.26
84	002600	领益智造	156,100	1,078,651.00	0.26
85	300136	信维通信	53,700	1,078,296.00	0.26
86	600060	海信视像	43,500	1,076,625.00	0.26
87	002138	顺络电子	44,700	1,068,777.00	0.26
88	002797	第一创业	186,700	1,067,924.00	0.26
89	002568	百润股份	29,100	1,057,785.00	0.26
90	002465	海格通信	102,200	1,056,748.00	0.26
91	603816	顾家家居	27,400	1,045,310.00	0.25
92	000021	深科技	51,900	1,037,481.00	0.25
93	603939	益丰药房	28,020	1,036,740.00	0.25
94	601128	常熟银行	152,000	1,036,640.00	0.25
95	600839	四川长虹	205,200	1,036,260.00	0.25
96	300253	卫宁健康	95,400	1,032,228.00	0.25

97	600160	巨化股份	74,860	1,031,570.80	0.25
98	002850	科达利	7,800	1,031,550.00	0.25
99	600563	法拉电子	7,501	1,029,887.30	0.25
100	000591	太阳能	151,900	1,029,882.00	0.25
101	300832	新产业	17,400	1,026,600.00	0.25
102	600879	航天电子	120,700	1,024,743.00	0.25
103	600873	梅花生物	114,500	1,022,485.00	0.25
104	688567	孚能科技	47,248	1,020,084.32	0.25
105	000683	远兴能源	140,600	1,010,914.00	0.25
106	601990	南京证券	122,800	1,004,504.00	0.24
107	600392	盛和资源	77,960	1,003,345.20	0.24
108	300699	光威复材	32,300	996,455.00	0.24
109	002368	太极股份	24,202	996,396.34	0.24
110	688521	芯原微电子	13,835	995,013.20	0.24
111	688169	石头科技	3,100	994,108.00	0.24
112	002078	太阳纸业	92,900	993,101.00	0.24
113	600497	驰宏锌锗	197,700	992,454.00	0.24
114	300866	安克创新	11,300	988,750.00	0.24
115	603589	口子窖	20,004	987,197.40	0.24
116	601696	中银证券	92,500	986,050.00	0.24
117	000729	燕京啤酒	78,200	975,154.00	0.24
118	300118	东方日升	37,900	971,377.00	0.24
119	600177	雅戈尔	153,900	971,109.00	0.24
120	002025	航天电器	15,200	969,760.00	0.24

121	600516	方大炭素	156,300	969,060.00	0.24
122	000831	中国稀土	32,600	964,960.00	0.23
123	002294	信立泰	30,900	963,771.00	0.23
124	300017	网宿科技	135,200	961,272.00	0.23
125	600141	兴发集团	43,140	958,570.80	0.23
126	688390	固德威电源	5,708	952,436.88	0.23
127	600642	申能股份	136,200	952,038.00	0.23
128	000728	国元证券	145,500	948,660.00	0.23
129	002673	西部证券	148,900	945,515.00	0.23
130	002430	杭氧股份	27,300	938,028.00	0.23
131	600699	均胜电子	53,100	936,684.00	0.23
132	000629	钒钛股份	238,400	932,144.00	0.23
133	002532	天山铝业	155,000	928,450.00	0.23
134	600170	上海建工	345,100	928,319.00	0.23
135	600118	中国卫星	32,800	925,288.00	0.23
136	600325	华发股份	93,800	923,930.00	0.22
137	002273	水晶光电	77,181	921,541.14	0.22
138	002268	电科网安	32,930	917,759.10	0.22
139	002195	二三四五	317,501	917,577.89	0.22
140	600153	建发股份	83,500	910,985.00	0.22
141	002372	伟星新材	44,280	909,511.20	0.22
142	002739	万达电影	72,500	909,150.00	0.22

143	600521	华海药业	49,300	907,613.00	0.22
144	600166	福田汽车	266,900	907,460.00	0.22
145	000400	许继电气	39,100	901,255.00	0.22
146	600486	扬农化工	10,300	900,426.00	0.22
147	300595	欧普康视	29,800	899,662.00	0.22
148	600143	金发科技	103,000	899,190.00	0.22
149	600549	厦门钨业	47,200	898,216.00	0.22
150	000998	隆平高科	58,500	897,975.00	0.22
151	603000	人民网	30,700	896,440.00	0.22
152	600399	抚顺特钢	87,700	894,540.00	0.22
153	688072	拓荆科技	2,100	894,537.00	0.22
154	000738	航发控制	36,600	893,040.00	0.22
155	688002	睿创微纳	19,852	889,369.60	0.22
156	600637	东方明珠	113,700	889,134.00	0.22
157	002065	东华软件	124,500	878,970.00	0.21
158	689009	九号公司	23,850	878,872.50	0.21
159	688220	翱捷科技	11,600	874,524.00	0.21
160	002444	巨星科技	39,900	873,012.00	0.21
161	600859	王府井	44,102	872,778.58	0.21
162	600481	双良节能	62,300	870,954.00	0.21
163	300487	蓝晓科技	13,950	870,759.00	0.21
164	601577	长沙银行	111,700	866,792.00	0.21
165	000997	新大	45,800	865,620.00	0.21

		陆			
166	300438	鹏辉能源	18,000	864,720.00	0.21
167	601198	东兴证券	107,800	864,556.00	0.21
168	002131	利欧股份	375,492	863,631.60	0.21
169	002353	杰瑞股份	34,291	861,732.83	0.21
170	300383	光环新网	79,900	858,925.00	0.21
171	600499	科达制造	75,500	857,680.00	0.21
172	600704	物产中大	173,300	856,102.00	0.21
173	000960	锡业股份	54,700	850,585.00	0.21
174	300682	朗新科技	36,500	849,720.00	0.21
175	600271	航天信息	61,600	843,304.00	0.21
176	600021	上海电力	78,300	843,291.00	0.21
177	000519	中兵红箭	46,300	837,567.00	0.20
178	601997	贵阳银行	162,300	837,468.00	0.20
179	300001	特锐德	40,301	837,454.78	0.20
180	002373	千方科技	61,300	836,132.00	0.20
181	603077	和邦生物	343,000	833,490.00	0.20
182	688009	中国通号	143,210	830,618.00	0.20
183	000623	吉林敖东	51,700	829,268.00	0.20
184	300676	华大基因	13,800	827,862.00	0.20
185	000703	恒逸石化	122,100	827,838.00	0.20
186	002056	横店东磁	45,200	823,092.00	0.20
187	002507	涪陵榨	44,850	821,203.50	0.20

		菜			
188	300088	长信科技	136,000	820,080.00	0.20
189	600380	健康元	64,108	814,812.68	0.20
190	600511	国药股份	20,902	812,042.70	0.20
191	000513	丽珠集团	20,864	811,818.24	0.20
192	688516	奥特维科技	4,300	810,120.00	0.20
193	600867	通化东宝	77,400	808,056.00	0.20
194	002152	广电运通	68,900	807,508.00	0.20
195	600498	烽火通信	39,600	806,652.00	0.20
196	002281	光迅科技	21,705	805,038.45	0.20
197	600998	九州通	77,331	802,695.78	0.20
198	600529	山东药玻	29,400	800,268.00	0.19
199	600546	山煤国际	55,000	795,850.00	0.19
200	002203	海亮股份	66,200	795,062.00	0.19
201	002299	圣农发展	41,400	792,810.00	0.19
202	600348	华阳股份	100,050	791,395.50	0.19
203	601016	节能风电	215,350	790,334.50	0.19
204	000636	风华高科	51,400	788,476.00	0.19
205	603338	浙江鼎力	14,000	784,140.00	0.19
206	600739	辽宁成大	59,400	781,110.00	0.19
207	603517	绝味食品	21,000	780,150.00	0.19
208	002595	豪迈科技	22,200	779,886.00	0.19
209	603712	七一二	25,676	775,671.96	0.19
210	688301	奕瑞科	2,740	773,858.20	0.19

		技股份			
211	603737	三棵树	11,760	769,339.20	0.19
212	601636	旗滨集团	89,200	768,904.00	0.19
213	002192	融捷股份	11,500	768,545.00	0.19
214	002080	中材科技	37,300	765,396.00	0.19
215	603927	中科软	19,720	760,403.20	0.19
216	002531	天顺风能	49,900	759,977.00	0.18
217	002506	协鑫集成	259,200	759,456.00	0.18
218	603885	吉祥航空	49,200	759,156.00	0.18
219	002432	九安医疗	21,500	757,015.00	0.18
220	600863	内蒙华电	181,000	751,150.00	0.18
221	688772	珠海冠宇电池	37,277	751,131.55	0.18
222	600970	中材国际	58,700	748,425.00	0.18
223	600580	卧龙电驱	50,900	743,649.00	0.18
224	002092	中泰化学	114,900	741,105.00	0.18
225	600655	豫园股份	107,900	740,194.00	0.18
226	688385	复旦微电	14,752	739,075.20	0.18
227	300182	捷成股份	117,000	738,270.00	0.18
228	300212	易华录	22,180	737,041.40	0.18
229	000878	云南铜业	66,600	735,930.00	0.18
230	600820	隧道股份	122,100	733,821.00	0.18
231	300296	利亚德	112,300	733,319.00	0.18
232	002683	广东宏大	24,900	733,056.00	0.18
233	600528	中铁工业	74,100	732,108.00	0.18

234	600909	华安证 券	156,670	731,648.90	0.18
235	002939	长城证 券	89,500	727,635.00	0.18
236	002926	华西证 券	87,500	727,125.00	0.18
237	600535	天士力	49,800	722,598.00	0.18
238	300244	迪安诊 断	27,801	712,539.63	0.17
239	300748	金力永 磁	23,800	712,096.00	0.17
240	603233	大参林	25,352	710,109.52	0.17
241	600329	达仁堂	15,800	709,262.00	0.17
242	000893	亚钾国 际	30,900	708,846.00	0.17
243	000547	航天发 展	70,800	708,000.00	0.17
244	000750	国海证 券	211,050	707,017.50	0.17
245	600258	首旅酒 店	37,200	704,940.00	0.17
246	600416	湘电股 份	36,900	704,421.00	0.17
247	000039	中集集 团	102,200	704,158.00	0.17
248	603160	汇顶科 技	15,200	703,000.00	0.17
249	600008	首创环 保	243,940	702,547.20	0.17
250	002557	洽洽食 品	16,800	698,040.00	0.17
251	000970	中科三 环	54,050	692,921.00	0.17
252	002429	兆驰股 份	125,800	691,900.00	0.17
253	603156	养元饮 品	28,000	691,600.00	0.17
254	000060	中金岭 南	145,100	689,225.00	0.17
255	688200	华峰测 控	4,500	688,500.00	0.17
256	601991	大唐发 电	206,800	684,508.00	0.17

257	603456	九洲药业	25,000	684,500.00	0.17
258	603893	瑞芯微	9,300	677,505.00	0.16
259	000830	鲁西化工	63,893	674,710.08	0.16
260	600390	五矿资本	125,100	673,038.00	0.16
261	603658	安图生物	13,000	672,490.00	0.16
262	600369	西南证券	184,000	671,600.00	0.16
263	600435	北方导航	58,200	668,718.00	0.16
264	300558	贝达药业	13,900	667,617.00	0.16
265	002500	山西证券	119,410	666,307.80	0.16
266	002508	老板电器	26,300	665,127.00	0.16
267	600398	海澜之家	95,900	659,792.00	0.16
268	002128	电投能源	49,800	658,356.00	0.16
269	002936	郑州银行	286,059	657,935.70	0.16
270	601880	辽港股份	418,900	653,484.00	0.16
271	300009	安科生物	64,976	649,760.00	0.16
272	600038	中直股份	16,300	649,066.00	0.16
273	300070	碧水源	120,400	645,344.00	0.16
274	002153	石基信息	45,578	638,092.00	0.16
275	601717	郑煤机	51,200	637,440.00	0.16
276	600848	上海临港	53,100	634,545.00	0.15
277	300026	红日药业	116,700	632,514.00	0.15
278	600985	淮北矿业	54,900	632,448.00	0.15
279	603858	步长制药	30,700	632,113.00	0.15

280	000050	深天马 A	68,300	626,994.00	0.15
281	300529	健帆生物	26,900	623,542.00	0.15
282	603127	昭衍新药	15,040	615,136.00	0.15
283	002572	索菲亚	35,300	614,926.00	0.15
284	688188	上海柏楚电子科技	3,260	614,705.60	0.15
285	601179	中国西电	113,600	614,576.00	0.15
286	002244	滨江集团	69,000	608,580.00	0.15
287	300373	扬杰科技	15,000	608,550.00	0.15
288	688779	长远锂科	53,652	604,658.04	0.15
289	002408	齐翔腾达	94,920	604,640.40	0.15
290	600673	东阳光	83,800	604,198.00	0.15
291	601456	国联证券	66,300	603,330.00	0.15
292	600895	张江高科	43,100	599,952.00	0.15
293	002266	浙富控股	145,200	599,676.00	0.15
294	003035	南网能源	84,100	598,792.00	0.15
295	601958	金铂股份	53,600	597,640.00	0.15
296	600827	百联股份	44,600	596,302.00	0.15
297	002019	亿帆医药	40,800	595,680.00	0.14
298	600667	太极实业	81,900	594,594.00	0.14
299	600566	济川药业	20,400	592,416.00	0.14
300	688116	天奈科技	12,906	590,449.50	0.14
301	000155	川能动力	41,000	590,400.00	0.14

302	002958	青农商行	216,400	588,608.00	0.14
303	603267	鸿远电子	9,000	587,700.00	0.14
304	688538	和辉光电	230,878	586,430.12	0.14
305	600208	新湖中宝	236,200	585,776.00	0.14
306	300357	我武生物	17,400	585,162.00	0.14
307	601666	平煤股份	77,200	582,088.00	0.14
308	000739	普洛药业	32,800	581,872.00	0.14
309	601000	唐山港	164,130	579,378.90	0.14
310	600282	南钢股份	171,200	576,944.00	0.14
311	600171	上海贝岭	31,500	574,875.00	0.14
312	600755	厦门国贸	74,000	572,760.00	0.14
313	600378	昊华科技	15,200	572,128.00	0.14
314	000887	中鼎股份	43,700	572,033.00	0.14
315	002155	湖南黄金	46,600	568,520.00	0.14
316	002670	国盛金控	64,298	564,536.44	0.14
317	300677	英科医疗	25,640	564,080.00	0.14
318	600959	江苏有线	166,700	563,446.00	0.14
319	600316	洪都航空	23,801	558,133.45	0.14
320	300115	长盈精密	46,520	554,053.20	0.13
321	300888	稳健医疗	13,260	552,544.20	0.13
322	601231	环旭电子	36,800	550,528.00	0.13
323	600315	上海家化	18,900	548,289.00	0.13

324	002487	大金重工	17,700	545,868.00	0.13
325	603218	日月股份	28,620	543,493.80	0.13
326	002030	达安基因	54,495	543,315.15	0.13
327	600517	国网英大	95,200	542,640.00	0.13
328	000778	新兴铸管	132,700	541,416.00	0.13
329	601866	中远海发	219,000	540,930.00	0.13
330	600056	中国医药	41,560	539,448.80	0.13
331	600131	国网信通	26,700	539,073.00	0.13
332	000598	兴蓉环境	99,200	538,656.00	0.13
333	300363	博腾股份	18,200	538,538.00	0.13
334	600582	天地科技	92,100	536,943.00	0.13
335	603026	胜华新材	9,000	533,250.00	0.13
336	688082	盛美上海半导体	4,800	529,920.00	0.13
337	000987	越秀资本	83,425	529,748.75	0.13
338	002221	东华能源	61,100	528,515.00	0.13
339	600598	北大荒	39,500	526,535.00	0.13
340	300251	光线传媒	65,000	525,850.00	0.13
341	002249	大洋电机	92,200	525,540.00	0.13
342	000027	深圳能源	79,260	522,323.40	0.13
343	002326	永太科技	34,100	521,389.00	0.13
344	601005	重庆钢铁	371,400	519,960.00	0.13
345	600906	财达证券	71,900	517,680.00	0.13

346	000709	河钢股份	228,600	516,636.00	0.13
347	002518	科士达	12,900	516,129.00	0.13
348	002183	怡亚通	100,600	513,060.00	0.12
349	601106	中国一重	151,900	510,384.00	0.12
350	002690	美亚光电	19,630	505,472.50	0.12
351	002831	裕同科技	20,680	504,385.20	0.12
352	601992	金隅集团	231,300	504,234.00	0.12
353	600718	东软集团	47,100	502,086.00	0.12
354	600373	中文传媒	37,600	500,832.00	0.12
355	000883	湖北能源	109,700	500,232.00	0.12
356	601665	齐鲁银行	127,400	499,408.00	0.12
357	603568	伟明环保	28,199	493,764.49	0.12
358	002511	中顺洁柔	44,279	493,710.85	0.12
359	000825	太钢不锈	126,900	491,103.00	0.12
360	601778	晶科科技	99,000	489,060.00	0.12
361	300776	帝尔激光	7,520	488,048.00	0.12
362	002985	北摩高科	11,010	485,761.20	0.12
363	601928	凤凰传媒	42,400	483,360.00	0.12
364	603228	景旺电子	18,801	482,245.65	0.12
365	603883	老百姓	16,147	481,987.95	0.12
366	600663	陆家嘴	48,700	480,669.00	0.12
367	600967	内蒙一机	47,400	478,740.00	0.12
368	600737	中粮糖业	59,300	477,365.00	0.12

369	600155	华创云信	75,300	468,366.00	0.11
370	603225	新凤鸣	42,320	467,636.00	0.11
371	600297	广汇汽车	224,700	467,376.00	0.11
372	600801	华新水泥	37,800	466,830.00	0.11
373	688281	华秦科技实业	2,300	465,750.00	0.11
374	688778	厦钨新能源	9,400	465,300.00	0.11
375	300861	美畅股份	10,700	464,059.00	0.11
376	603529	爱玛科技	14,400	463,968.00	0.11
377	601098	中南传媒	39,800	461,680.00	0.11
378	300482	万孚生物	17,290	460,432.70	0.11
379	002468	申通快递	42,500	459,850.00	0.11
380	002791	坚朗五金	7,100	459,441.00	0.11
381	688208	道通科技	15,122	458,347.82	0.11
382	000012	南玻 A	76,265	454,539.40	0.11
383	002745	木林森	49,300	453,560.00	0.11
384	001227	兰州银行	158,500	453,310.00	0.11
385	002032	苏泊尔	9,000	450,000.00	0.11
386	603866	桃李面包	44,355	448,872.60	0.11
387	600871	石化油服	226,600	448,668.00	0.11
388	000156	华数传媒	51,400	447,180.00	0.11
389	600500	中化国际	79,900	444,244.00	0.11
390	000581	威孚高科	27,900	439,425.00	0.11
391	000401	冀东水	59,100	435,567.00	0.11

		泥			
392	688690	纳微科技	11,177	434,226.45	0.11
393	002867	周大生	24,400	433,832.00	0.11
394	688276	长春百克生物科技	6,900	431,940.00	0.11
395	301029	怡合达	9,660	431,608.80	0.11
396	002250	联化科技	40,900	427,814.00	0.10
397	600556	天下秀	60,300	427,527.00	0.10
398	688029	南微医学科技	5,220	425,743.20	0.10
399	601118	海南橡胶	94,900	425,152.00	0.10
400	601611	中国核建	50,200	424,190.00	0.10
401	600022	山东钢铁	296,600	421,172.00	0.10
402	688520	神州细胞集团公司	7,400	419,876.00	0.10
403	000930	中粮科技	51,700	418,770.00	0.10
404	000785	居然之家	109,000	415,290.00	0.10
405	002010	传化智联	77,800	413,896.00	0.10
406	300850	新强联	11,000	411,180.00	0.10
407	002423	中粮资本	51,100	408,800.00	0.10
408	688006	浙江杭可科技	13,398	408,237.06	0.10
409	601598	中国外运	87,300	406,818.00	0.10
410	600259	广晟有色	11,200	404,768.00	0.10
411	601608	中信重工	96,100	404,581.00	0.10
412	600062	华润双鹤	23,100	402,402.00	0.10
413	000559	万向钱潮	73,500	400,575.00	0.10

414	002081	金螳螂	88,800	400,488.00	0.10
415	002505	鹏都农牧	211,400	399,546.00	0.10
416	600597	光明乳业	38,200	397,280.00	0.10
417	600782	新钢股份	106,600	395,486.00	0.10
418	000089	深圳机场	56,900	395,455.00	0.10
419	603826	坤彩科技	7,800	390,000.00	0.09
420	300618	寒锐钴业	12,000	388,920.00	0.09
421	000958	电投产融	89,200	386,236.00	0.09
422	600901	江苏金租	93,100	384,503.00	0.09
423	603638	艾迪精密	18,720	384,134.40	0.09
424	688052	纳芯微电子	2,400	380,088.00	0.09
425	600339	中油工程	93,300	379,731.00	0.09
426	600707	彩虹股份	79,700	379,372.00	0.09
427	000937	冀中能源	58,900	375,782.00	0.09
428	600409	三友化工	68,800	374,960.00	0.09
429	688107	安路科技	6,700	371,113.00	0.09
430	600095	湘财股份	47,500	370,500.00	0.09
431	000898	鞍钢股份	132,400	368,072.00	0.09
432	601187	厦门银行	73,000	366,460.00	0.09
433	603707	健友股份	27,059	365,296.50	0.09
434	002761	浙江建投	24,000	364,320.00	0.09
435	000537	广宇发展	31,100	362,937.00	0.09

436	601718	际华集团	121,800	361,746.00	0.09
437	600507	方大特钢	77,749	359,977.87	0.09
438	000415	渤海租赁	171,000	359,100.00	0.09
439	600167	联美控股	51,080	356,027.60	0.09
440	688234	天岳先进	4,800	354,912.00	0.09
441	000967	盈峰环境	70,200	354,510.00	0.09
442	001914	招商积余	23,500	353,675.00	0.09
443	601568	北元集团	66,190	348,821.30	0.08
444	600968	海油发展	112,900	346,603.00	0.08
445	600808	马钢股份	134,500	345,665.00	0.08
446	000563	陕国投 A	113,020	344,711.00	0.08
447	601156	东航物流	26,400	343,200.00	0.08
448	002925	盈趣科技	17,480	339,112.00	0.08
449	300257	开山股份	22,101	335,272.17	0.08
450	002705	新宝股份	18,400	331,752.00	0.08
451	600195	中牧股份	28,249	329,948.32	0.08
452	600126	杭钢股份	75,320	326,888.80	0.08
453	603650	彤程新材	9,900	324,720.00	0.08
454	600764	中国海防	11,900	323,918.00	0.08
455	300442	润泽科技	10,400	319,904.00	0.08
456	603379	三美股份	13,600	319,736.00	0.08
457	002608	江苏国信	41,800	316,426.00	0.08

458	688185	康希诺生物	3,800	309,700.00	0.08
459	000959	首钢股份	86,700	303,450.00	0.07
460	000402	金融街	66,400	300,128.00	0.07
461	603786	科博达	4,500	295,650.00	0.07
462	002653	海思科	12,400	292,640.00	0.07
463	601828	美凯龙	60,400	289,316.00	0.07
464	002110	三钢闽光	68,250	288,015.00	0.07
465	001203	大中矿业	25,200	279,972.00	0.07
466	002563	森马服饰	45,000	279,900.00	0.07
467	688819	天能电池集团股份	7,474	275,342.16	0.07
468	688289	圣湘生物	16,307	274,609.88	0.07
469	600377	宁沪高速	27,600	271,308.00	0.07
470	601298	青岛港	38,900	271,133.00	0.07
471	601228	广州港	83,900	270,997.00	0.07
472	603056	德邦股份	17,101	263,697.42	0.06
473	600623	华谊集团	42,000	261,660.00	0.06
474	000031	大悦城	71,100	260,226.00	0.06
475	600927	永安期货	16,000	260,160.00	0.06
476	600928	西安银行	73,600	259,072.00	0.06
477	603317	天味食品	17,616	257,369.76	0.06
478	601869	长飞光纤	6,800	251,668.00	0.06
479	600350	山东高速	37,700	240,149.00	0.06
480	002399	海普瑞	20,900	239,723.00	0.06
481	601136	首创证券	16,600	235,222.00	0.06
482	601139	深圳燃	31,800	231,822.00	0.06

		气			
483	000869	张裕 A	7,500	229,950.00	0.06
484	601969	海南矿业	33,900	223,062.00	0.05
485	001872	招商港口	12,900	222,783.00	0.05
486	600995	南网储能	19,400	213,594.00	0.05
487	002945	华林证券	15,000	205,200.00	0.05
488	688105	诺唯赞生物	6,700	204,283.00	0.05
489	000553	安道麦 A	24,100	203,404.00	0.05
490	688248	南方电网电力科技	4,700	180,433.00	0.04
491	600299	安迪苏	22,400	178,528.00	0.04
492	601158	重庆水务	31,800	176,808.00	0.04
493	603868	飞科电器	2,700	170,343.00	0.04
494	688295	中复神鹰碳纤维	4,500	165,060.00	0.04
495	603355	莱克电气	6,342	161,150.22	0.04
496	600032	浙江新能	11,900	149,464.00	0.04
497	600956	新天绿能	16,833	146,783.76	0.04
498	300741	华宝股份	6,800	145,656.00	0.04
499	002901	大博医疗	3,300	102,564.00	0.02

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

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	688361	中科飞测	3,321	269,568.99	0.07
2	688472	阿特斯阳光电力	14,329	261,188.88	0.06
3	301310	鑫宏业	3,450	236,445.75	0.06
4	688443	智翔金泰	7,279	223,960.13	0.05
5	688562	航天软件股份	7,254	195,390.66	0.05
6	301399	英特科技	2,925	171,714.01	0.04
7	688629	四川华丰科技	7,073	160,957.02	0.04
8	301320	豪江智能	6,416	155,624.88	0.04
9	688334	西高院	8,643	153,714.53	0.04
10	688458	美芯晟科技	1,604	153,385.67	0.04
11	301383	天键股份	4,056	151,012.32	0.04
12	688620	安凯微电子	10,157	135,209.66	0.03
13	301315	威士顿	2,253	132,828.53	0.03
14	688523	航天环宇科技	4,717	125,405.25	0.03
15	301225	恒勃股份	3,324	118,422.57	0.03
16	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.03
17	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.03
18	301262	海看股份	3,735	102,804.75	0.03
19	301355	南王科技	5,624	99,516.05	0.02
20	301376	致欧科技	4,192	98,850.60	0.02
21	688623	二元科技	1,026	93,735.38	0.02
22	301170	锡南科技	2,496	92,283.70	0.02
23	688581	安杰思医学	708	86,406.26	0.02
24	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.02
25	301337	亚华电子	2,318	78,804.24	0.02
26	300804	广康生化	2,257	77,134.83	0.02
27	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.02
28	001282	三联锻造	812	28,769.46	0.01
29	688582	芯动联科	467	18,997.56	0.00
30	301397	溯联股份	284	11,416.80	0.00
31	688631	莱斯信息	326	9,737.62	0.00
32	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
33	301265	华新环保	806	9,365.72	0.00
34	000540	*ST 中天	283,500	2,835.00	0.00
35	000656	金科股份	1,400	1,554.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601966	玲珑轮胎	1,759,667.00	0.41
2	002463	沪电股份	1,581,314.00	0.37
3	000066	中国长城	1,498,261.00	0.35
4	600372	中航电子	1,355,688.08	0.32
5	000423	东阿阿胶	1,299,680.00	0.30
6	002240	盛新锂能	1,214,640.00	0.28
7	000933	神火股份	1,209,391.00	0.28
8	002008	大族激光	1,142,419.00	0.27
9	603882	金域医学	1,109,603.00	0.26
10	688169	石头科技	1,022,390.68	0.24
11	300395	菲利华	995,736.29	0.23
12	002600	领益智造	987,619.00	0.23
13	688220	翱捷科技	972,718.46	0.23
14	300487	蓝晓科技	882,513.00	0.21
15	300118	东方日升	882,003.00	0.21
16	688072	拓荆科技	872,495.89	0.20
17	002432	九安医疗	867,970.00	0.20
18	300595	欧普康视	848,908.00	0.20
19	300438	鹏辉能源	826,189.00	0.19
20	600481	双良节能	758,145.00	0.18

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	603345	安井食品	1,767,585.00	0.41
2	688122	西部超导	1,748,793.56	0.41
3	601607	上海医药	1,702,469.00	0.40
4	000999	华润三九	1,588,192.00	0.37
5	002603	以岭药业	1,486,572.40	0.35
6	603606	东方电缆	1,394,429.00	0.33
7	603605	珀莱雅	1,375,303.80	0.32

8	601699	潞安环能	1,358,188.00	0.32
9	601872	招商轮船	1,313,152.00	0.31
10	603613	国联股份	1,295,262.80	0.30
11	688063	派能科技	1,165,495.10	0.27
12	300168	万达信息	1,158,878.00	0.27
13	600026	中远海能	1,129,569.00	0.26
14	002212	天融信	822,141.00	0.19
15	601333	广深铁路	811,999.00	0.19
16	600201	生物股份	753,628.24	0.18
17	600728	佳都科技	681,846.00	0.16
18	002396	星网锐捷	651,573.00	0.15
19	300418	昆仑万维	643,163.00	0.15
20	688088	虹软科技	568,951.09	0.13

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	70,167,735.90
卖出股票收入（成交）总额	94,513,734.39

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列，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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	3,851,044.11	0.94
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	111,634.85	0.03
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	-	-
10	其他	-	-
11	合计	3,962,678.96	0.96

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	019688	22 国债 23	25,000	2,527,981.51	0.62
2	019638	20 国债 09	7,000	716,404.74	0.17
3	019694	23 国债 01	6,000	606,657.86	0.15
4	118030	睿创转债	770	111,634.85	0.03

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等,以降低交易成本和组合风险,提高投资效率。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国人民银行及其派出机构、国家金融监督管理总局(前身为中国银保监会)及其派出机构、中国证监会及其派出机构、国家市场监督管理总局及机关单位、交易所立案调查,或在报告编制日前一年内收到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

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	1,066,913.14
2	应收清算款	205,640.36
3	应收股利	30,024.69
4	应收利息	-
5	应收申购款	581,739.10
6	其他应收款	15,735.03
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,900,052.32

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	1,562,970.00	0.38	转融通出借流通受限
2	688256	寒武纪科技	658,000.00	0.16	转融通出借流通受限
3	600372	中航电子	566,214.00	0.14	转融通出借流通受限
4	300418	昆仑万维	523,640.00	0.13	转融通出借流通受限
5	601966	玲珑轮胎	333,300.00	0.08	转融通出借流通受限
6	300012	华测检测	19,500.00	0.00	转融通出借流通受限

					限
--	--	--	--	--	---

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	688472	阿特斯阳光电力	24,418.32	0.01	新股流通受限
2	301310	鑫宏业	22,573.35	0.01	新股流通受限
3	688361	中科飞测	21,535.11	0.01	新股流通受限
4	688443	智翔金泰	21,468.72	0.01	新股流通受限
5	688562	航天软件股份	16,197.06	0.00	新股流通受限

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
汇添富中证 500 指数 (LOF) A	15,750	16,062.11	10,010,000.00	3.96	242,968,171.99	96.04
汇添富中证 500 指数 (LOF) C	18,822	6,095.62	674,036.98	0.59	114,057,753.77	99.41
合计	34,572	10,636.06	10,684,036.98	2.91	357,025,925.76	97.09

8.2 期末上市基金前十名持有人

汇添富中证 500 指数 (LOF) A			
序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	钟爱民	166,061.00	2.68
2	高明英	137,684.00	2.22
3	何涛	130,000.00	2.10
4	余建萍	127,722.00	2.06
5	王开德	117,339.00	1.89
6	王文惠	105,293.00	1.70
7	王轶轮	104,512.00	1.69
8	李峰	101,125.00	1.63
9	陈靖	99,412.00	1.60
10	闫丽京	99,412.00	1.60
汇添富中证 500 指数 (LOF) C			
序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	黄晖	1,645,349.00	41.60
2	赵丽妹	200,018.00	5.06
3	于文华	150,175.00	3.80
4	欧阳东	150,000.00	3.79
5	吴斌珍	100,000.00	2.53
6	顾奔驰	99,018.00	2.50
7	黄晓云	77,358.00	1.96
8	凌云志	60,000.00	1.52
9	殷彭深	60,000.00	1.52
10	曲吉武	51,000.00	1.29

注：本基金为 LOF 基金，上表持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	399,926.09	0.16
	汇添富中证 500 指数 (LOF) C	1,875.39	0.00
	合计	401,801.48	0.11

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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	0
	汇添富中证 500 指数 (LOF) C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	0
	汇添富中证 500 指数 (LOF) C	0
	合计	0

8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

注：本基金成立后有 10,002,700.27 份为发起份额，发起份额承诺的持有期限为 2017 年 08 月 10 日（合同生效日）起 3 年。截至本报告期末，最低持有期限届满，发起资金持有份额为 0.00 份。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C
基金合同生效日 (2017 年 08 月 10 日) 基金份额总额	346,914,435.24	388,890,254.39
本报告期期初基金份额总额	257,196,188.48	137,618,839.08
本报告期基金总申购份额	54,721,594.16	93,502,390.66
减：本报告期基金总赎回份额	58,939,610.65	116,389,438.99
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	252,978,171.99	114,731,790.75

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内本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

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期无涉及公募基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为安永华明会计师事务所（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

注：本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其托管业务高级管理人员未受稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	

			(%)			
招商 证券	2	161,071,840.89	100.00	116,182.49	100.00	

注:此处的佣金指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券商的佣金合计,不单指股票交易佣金。

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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
招商 证券	11,114,396.00	100.00	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

- (1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。
- (2) 交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。
- (3) 投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例,并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整,使得总的交易量的分配符合综合排名,同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的 30%。
- (4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况,作为增加或更换券商交易单元的依据。
- (5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定,投资总监审批。
- (6) 成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成;更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。
- (7) 调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用,基金会计应负责协助及时催缴。
- (8) 按照《关于基金管理公司向会员租用交易单元有关事项的通知》规定,同一基金管理

公司托管在同一托管银行的基金可以共用同一交易单元进行交易。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

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	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2022 年第四季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 01 月 20 日
2	关于防范不法分子冒用汇添富基金名义进行非法活动的重要提示	公司网站	2023 年 03 月 13 日
3	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2022 年年度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 03 月 31 日
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2023 年第一季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 21 日
5	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金估值调整情况的公告	中证报, 上交所, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 17 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者超过 20%的情况

注：无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）募集的文件；
- 2、《汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》；

- 3、《汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）在规定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 www.99fund.com 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司

2023 年 08 月 31 日