

中证 500 交易型开放式指数证券投资 基金 2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 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及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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告.....	6
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	11
§5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	11
§6 中期财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 净资产变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	83
7.1 期末基金资产组合情况.....	83
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	84
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	85
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	98
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	99
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.....	100
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.....	100
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.....	100

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	100
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	100
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	100
7.12	投资组合报告附注	101
§8	基金份额持有人信息	102
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	102
8.2	期末上市基金前十名持有人	102
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	103
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	103
§9	开放式基金份额变动	103
§10	重大事件揭示	104
10.1	基金份额持有人大会决议	104
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	104
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	104
10.4	基金投资策略的改变	104
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	104
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	104
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	104
10.8	其他重大事件	106
§11	影响投资者决策的其他重要信息	106
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	107
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	107
§12	备查文件目录	107
12.1	备查文件目录	107
12.2	存放地点	107
12.3	查阅方式	107

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方中证 500ETF
场内简称	500ETF; 中证 500ETF
基金主代码	510500
交易代码	510500
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 2 月 6 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	14,773,768,617.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013 年 3 月 15 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为被动式指数基金，采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为中证 500 指数。
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	南方基金管理股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川
	联系电话	0755-82763888
	电子邮箱	manager@southernfund.com
客户服务电话	400-889-8899	95599
传真	0755-82763889	010-68121816
注册地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址	深圳市福田区莲花街道 益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518017	100031
法定代表人	周易	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址、基金上市交易的证券交易所（如有）

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日 - 2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	327,244,845.24
本期利润	-1,677,223,820.22
加权平均基金份额本期利润	-0.1311
本期加权平均净值利润率	-2.46%
本期基金份额净值增长率	-8.01%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	27,880,147,384.79
期末可供分配基金份额利润	1.8871
期末基金资产净值	73,891,822,990.96
期末基金份额净值	5.0016
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	63.16%

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

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

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

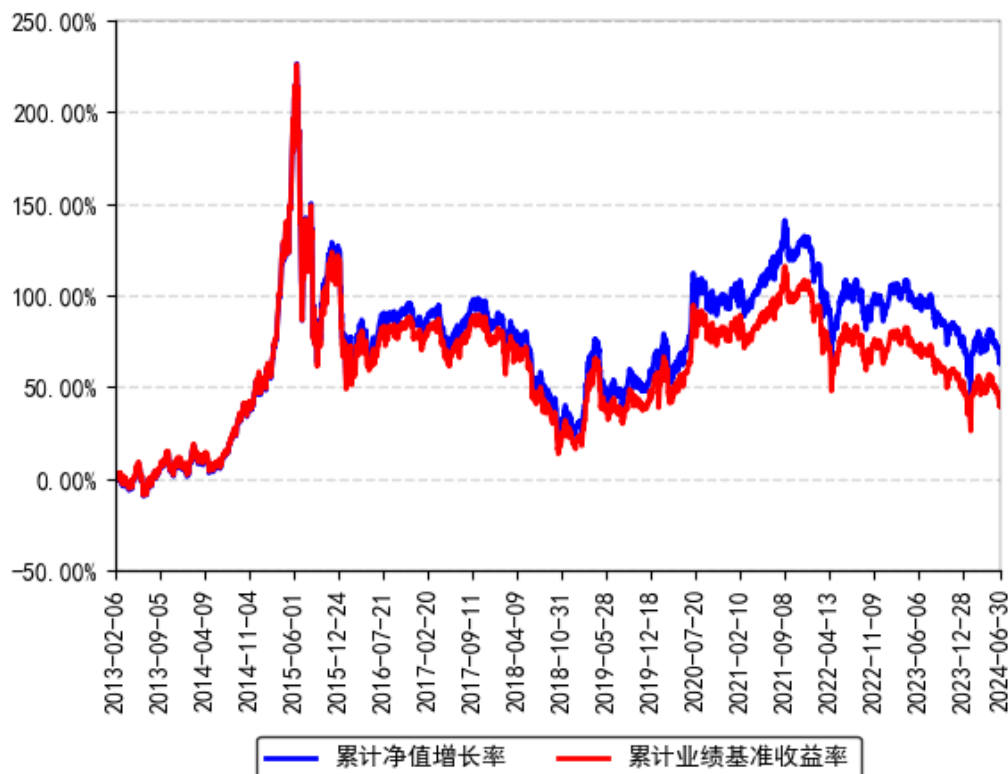
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-6.24%	0.96%	-6.89%	0.96%	0.65%	0.00%
过去三个月	-5.36%	1.14%	-6.50%	1.14%	1.14%	0.00%
过去六个月	-8.01%	1.60%	-8.96%	1.61%	0.95%	-0.01%
过去一年	-16.53%	1.27%	-17.60%	1.27%	1.07%	0.00%
过去三年	-23.52%	1.19%	-27.40%	1.20%	3.88%	-0.01%
自基金合同生效起至今	63.16%	1.56%	39.45%	1.56%	23.71%	0.00%

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

南方中证500ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 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

1998 年 3 月 6 日，经中国证监会批准，南方基金管理有限公司作为国内首批规范的基金管理公司正式成立，成为我国“新基金时代”的起始标志。

2018 年 1 月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司。目前，公司总部设在深圳，在北京、上海、深圳、南京、成都、合肥等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司（香港子公司）和南方资本管理有限公司（深圳子公司）。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

南方基金管理股份有限公司旗下管理公募基金、全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和专户组合，已发展成为产品种类丰富、业务领域全面、经营业绩优秀、资产管理规模位居前列的基金管理公司之一。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
罗文杰	本基金基金经理	2013 年 4 月 22 日	-	19 年	女，美国南加州大学数学金融硕士、美国加州大学计算机科学硕士，具有基金从业资格。曾任职于摩根士丹利投资银行，从事量化分析工作。2008 年 9 月加入南方基金，曾任南方基金数量化投资部基金经理助理；现任指数投资部总经理。2013 年 5 月 17 日至 2015 年 6 月 16 日，任南方策略基金经理；2017 年 11 月 9 日至 2019 年 1 月 18 日，任南方策略、南方量化混合基金经理；2016 年 12 月 30 日至 2019 年 4 月 18 日，任南方安享绝对收益、南方卓享绝对收益基金经理；2018 年 2 月 8 日至 2020 年 3 月 27 日，任 H 股 ETF 基金经理；2018 年 2 月 12 日至 2020 年 3 月 27 日，任南方 H 股联接基金经理；2014 年 10 月 30 日至 2020 年 12 月 23 日，任 500 医药基金经理；2021 年 3 月 12 日至 2023 年 2 月 24 日，任南方中证创新药产业 ETF 基金经理；2021 年 10 月 22 日至 2023 年 2 月 24 日，任南方中证全指医疗保健 ETF 基金经理；2020 年 12 月 25 日至 2023 年 8 月 25 日，任南方策略基金经理；2021 年 7 月 2 日至 2023 年 8 月 25 日，任南

				<p>方中证香港科技 ETF (QDII) 基金经理; 2022 年 6 月 17 日至 2023 年 8 月 25 日, 任南方恒生香港上市生物科技 ETF (QDII) 基金经理; 2013 年 4 月 22 日至今, 任南方 500、南方 500ETF 基金经理; 2013 年 5 月 17 日至今, 任南方 300、南方 300 联接基金经理; 2015 年 2 月 16 日至今, 任南方恒生 ETF 基金经理; 2017 年 7 月 21 日至今, 任恒生联接基金经理; 2017 年 8 月 24 日至今, 任南方房地产联接基金经理; 2017 年 8 月 25 日至今, 任南方房地产 ETF 基金经理; 2018 年 4 月 3 日至今, 任 MSCI 基金基金经理; 2018 年 6 月 8 日至今, 任 MSCI 联接基金经理; 2020 年 7 月 24 日至今, 兼任投资经理; 2023 年 5 月 30 日至今, 任南方恒生香港上市生物科技 ETF 发起联接(QDII) 基金经理; 2024 年 6 月 26 日至今, 任南方中证国新港股通央企红利 ETF 基金经理。</p>
--	--	--	--	--

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券投资基金从业人员范围的相关规定。

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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
罗文杰	公募基金	12	94,898,159,790.48	2013 年 04 月 22 日
	私募资产管理计划	8	2,644,004,064.49	2020 年 08 月 07 日
	其他组合	-	-	-
	合计	20	97,542,163,854.97	-

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和本基金基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

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

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。

本报告期内，两两组合间单日、3 日、5 日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为 0 的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内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% 的交易次数为 69 次，是由于指数投资组合的投资策略导致。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年上半年，宏观经济复苏节奏相对平缓，A 股市场在政策持续加码和外部地缘扰动下呈现逐步筑底、震荡整固态势。

1. 沪深 300 指数上涨 0.89%，中证 500 下跌 8.96%，创业板指下跌 10.99%，科创 50 下跌 16.42%。

2. 行业方面，风险偏好下行，市场资金拥抱具有盈利确定性的泛公用事业和国央企资产，银行、电力及公用事业、交通运输等行业涨幅领先。综合、消费者服务、传媒等行业回调较大。

3. 宏观经济数据结构性分化及外部扰动下市场风险偏好阶段承压，低估值低波动标的相对占优。

报告期内，中证 500 指数跌 8.96%。

期间我们通过自建的指数化交易系统、日内择时交易模型、跟踪误差归因分析系统、ETF 现金流精算系统等，将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平，并通过严格的风险管理流程，确保了本基金的安全运作。

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

(1) 大额申购赎回带来的成份股权重偏差，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；

(2) 报告期内指数成份股（包括调出指数成份股）的长期停牌，引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的微小偏离；

(3) 股指期货和现货之间的基差波动带来的本基金与基准的偏离；

(4) 报告期内，我们根据指数定期的成份股调整进行了基金调仓，事前我们制定了详细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，从实施结果来看，效果良好，跟踪误差控制在理想范围内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 5.0016 元，报告期内，份额净值增长率为-8.01%，同期业绩基准增长率为-8.96%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中证 500 是 A 股市场核心中盘股指数，随着 A 股市场扩容与成分股市值增长，中证 500 总市值不断扩大，目前已增长至约 12 万亿元，流通市值约 6 万亿元。成分股总市值中位数从 2010 年的 60 多亿元增长至目前的 200 多亿元。随着中国经济转型发展和 A 股市场的变迁，中证 500 的行业构成不断迭代，房地产、基础化工等传统行业权重逐渐下滑，而医药生物、电子、电力设备等新兴行业权重逐渐占据主导地位。从申万二级行业上看，中证 500 成分股共涉及 100 多个细分行业，并且成分股在 80 多个细分行业中总市值位居前 10%，在 80 多个细分行业中营业收入位居前 10%。在我国逐渐转向创新驱动发展的过程中，中证 500 指数不仅受益于国家对科技创新领域的政策支持、新经济行业本身快速增长的红利，还能够享受各细分行业龙头公司在经济转型与集中度提升下的竞争优势。当前内外部环境均现好转，随着经济逐步复苏回暖，中小盘股盈利有望见底回升。而指数仍被大幅低估，具有较高的安全边际。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，组成人员包括副总经理、督察长、权益研究部总经理、固定收益研究部总经理、指数投资部总经理、现金及债券指数投资部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。本基金托管人根据法律法规要求履行估值

及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金进行了收益分配，符合法律法规和基金合同约定。具体如下：

权益登记日 2024 年 5 月 16 日，每 10 份基金份额分红数 0.8700。

4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个交易日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—南方基金管理股份有限公司本报告期基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，南方基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，南方基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.3.1	122,336,531.06	805,318,888.56
结算备付金		1,414,547,494.42	707,749,719.50
存出保证金		218,278,499.09	207,964,267.28
交易性金融资产	6.4.3.2	72,285,014,683.01	45,121,518,598.67
其中：股票投资		72,274,850,925.66	45,121,518,598.67
基金投资		-	-
债券投资		10,163,757.35	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		69,658,126.10	33,919,719.37
应收股利		4,018,970.51	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.5	1,009,995.59	2,773,094.59
资产总计		74,114,864,299.78	46,879,244,287.97
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	79,363.72

应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		29,447,626.52	18,660,575.39
应付托管费		5,889,525.32	3,732,115.08
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		147,237.19	242,497.39
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.6	187,556,919.79	108,303,277.13
负债合计		223,041,308.82	131,017,828.71
净资产：			
实收基金	6.4.3.7	46,011,675,606.17	26,355,967,254.27
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.8	27,880,147,384.79	20,392,259,204.99
净资产合计		73,891,822,990.96	46,748,226,459.26
负债和净资产总计		74,114,864,299.78	46,879,244,287.97

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 5.0016 元，基金份额总额 14,773,768,617.00 份。

6.2 利润表

会计主体：中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-1,461,500,129.72	3,259,708,781.42
1.利息收入		52,387,903.65	74,489,881.11
其中：存款利息收入	6.4.3.9	15,154,825.71	12,799,375.90
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		37,233,077.94	61,690,505.21
2.投资收益（损失以“-”填列）		261,375,883.98	801,376,676.66
其中：股票投资收益	6.4.3.10	-630,956,921.04	236,691,933.36
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.11	2,996,181.63	6,641,358.88
资产支持证券投资		-	-

收益			
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.12	-38,159,321.52	35,752,792.12
股利收益	6.4.3.13	927,495,944.91	522,290,592.30
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）	6.4.3.14	-2,004,468,665.46	2,352,199,120.53
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.15	229,204,748.11	31,643,103.12
减：二、营业总支出		215,723,690.50	162,794,469.31
1.管理人报酬	6.4.6.2.1	170,947,951.70	128,751,632.93
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.6.2.2	34,189,590.38	25,750,326.59
3.销售服务费	6.4.6.2.3	-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		134,047.48	381,638.14
8.其他费用	6.4.3.16	10,452,100.94	7,910,871.65
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,677,223,820.22	3,096,914,312.11
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,677,223,820.22	3,096,914,312.11
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,677,223,820.22	3,096,914,312.11

6.3 净资产变动表

会计主体：中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净	26,355,967,254.2	-	20,392,259,204.9	46,748,226,459.2

资产	7		9	6
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	26,355,967,254.27	-	20,392,259,204.99	46,748,226,459.26
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	19,655,708,351.90	-	7,487,888,179.80	27,143,596,531.70
（一）、综合收益总额	-	-	-1,677,223,820.22	-1,677,223,820.22
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	19,655,708,351.90	-	10,371,503,599.30	30,027,211,951.20
其中：1.基金申购款	46,941,738,259.17	-	30,007,845,145.56	76,949,583,404.73
2.基金赎回款	-27,286,029,907.27	-	-19,636,341,546.26	-46,922,371,453.53
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-1,206,391,599.28	-1,206,391,599.28
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	46,011,675,606.17	-	27,880,147,384.79	73,891,822,990.96
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	31,927,036,315.57	-	28,417,847,422.54	60,344,883,738.11
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	31,927,036,315.57	-	28,417,847,422.54	60,344,883,738.11

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-7,170,633,612.38	-	-4,779,228,332.21	-11,949,861,944.59
(一)、综合收益总额	-	-	3,096,914,312.11	3,096,914,312.11
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-7,170,633,612.38	-	-7,876,142,644.32	-15,046,776,256.70
其中：1.基金申购款	15,174,685,212.34	-	15,122,768,077.30	30,297,453,289.64
2.基金赎回款	-22,345,318,824.72	-	-22,998,910,721.62	-45,344,229,546.34
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	24,756,402,703.19	-	23,638,619,090.33	48,395,021,793.52

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：

____杨小松____ ____常克川____ ____徐超____
 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 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。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.2.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	122,336,531.06
等于：本金	122,248,268.05
加：应计利息	88,263.01
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	122,336,531.06

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	77,638,968,963.39	-	72,274,850,925.66	-5,364,118,037.73	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	10,163,000.00	757.35	10,163,757.35	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	10,163,000.00	757.35	10,163,757.35	-
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	77,649,131,963.39	757.35	72,285,014,683.01	-5,364,118,037.73	

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

6.4.3.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	1,738,715,514.82	-	-	-
— 股指期货	1,738,715,514.82	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,738,715,514.82	-	-	-

6.4.3.3.2 期末基金持有的期货合约情况

金额单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2409	IC2409	10.00	9,750,400.00	-442,260.00
IC2412	IC2412	1,644.00	1,589,353,440.00	-139,169,414.82
合计				-139,611,674.82
减：可抵销期货暂收款				-139,611,674.82
净额				-

注：1、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

2、衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

6.4.3.4 买入返售金融资产

6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.3.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	1,009,995.59
待摊费用	-
可收退补款	-

应收退补款	-
合计	1,009,995.59

6.4.3.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	4,288,086.57
其中：交易所市场	4,288,086.57
银行间市场	-
应付利息	-
应退退补款	175,572,463.80
预提费用	134,263.22
应付指数使用费	5,617,170.82
可退替代款	1,944,935.38
合计	187,556,919.79

6.4.3.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,462,568,617.00	26,355,967,254.27
本期申购	15,072,400,000.00	46,941,738,259.17
本期赎回（以“-”号填列）	-8,761,200,000.00	-27,286,029,907.27
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	14,773,768,617.00	46,011,675,606.17

注：红利再投及转入份额计入本期申购，转出份额计入本期赎回。

6.4.3.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	48,800,448,569.34	-28,408,189,364.35	20,392,259,204.99
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	48,800,448,569.34	-28,408,189,364.35	20,392,259,204.99
本期利润	327,244,845.24	-2,004,468,665.46	-1,677,223,820.22
本期基金份额交易产	35,463,350,136.14	-25,091,846,536.84	10,371,503,599.30

生的变动数			
其中：基金申购款	84,994,132,079.52	-54,986,286,933.96	30,007,845,145.56
基金赎回款	-49,530,781,943.38	29,894,440,397.12	-19,636,341,546.26
本期已分配利润	-1,206,391,599.28	-	-1,206,391,599.28
本期末	83,384,651,951.44	-55,504,504,566.65	27,880,147,384.79

6.4.3.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,739,983.73
定期存款利息收入	6,549,722.14
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	5,697,327.22
其他	167,792.62
合计	15,154,825.71

6.4.3.10 股票投资收益

6.4.3.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-591,271,414.78
股票投资收益——赎回差价收入	-39,685,506.26
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	-630,956,921.04

6.4.3.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	35,259,128,275.43
减：卖出股票成本总额	35,818,690,573.79
减：交易费用	31,709,116.42
买卖股票差价收入	-591,271,414.78

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

6.4.3.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	46,922,371,453.53
减：现金支付赎回款总额	24,134,622,804.53
减：赎回股票成本总额	22,827,434,155.26
减：交易费用	-

赎回差价收入	-39,685,506.26
--------	----------------

6.4.3.10.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

6.4.3.11 债券投资收益

6.4.3.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	2,328.47
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,993,853.16
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	2,996,181.63

6.4.3.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	13,657,040.56
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	10,661,000.00
减：应计利息总额	1,640.89
减：交易费用	546.51
买卖债券差价收入	2,993,853.16

注：上述交易费用（如有）包含债券买卖产生的交易费用。

6.4.3.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.3.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.3.12 衍生工具收益

6.4.3.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

6.4.3.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
----	------------------------------------

股指期货-投资收益	-38,159,321.52
-----------	----------------

6.4.3.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	927,495,944.91
其中：证券出借权益补偿收入	63,013,146.56
基金投资产生的股利收益	-
合计	927,495,944.91

6.4.3.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-1,893,109,242.97
——股票投资	-1,893,109,242.97
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-111,359,422.49
——权证投资	-
——期货投资	-111,359,422.49
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	-2,004,468,665.46

6.4.3.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	229,204,748.11
合计	229,204,748.11

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代证券的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额，或强制退款的被替代证券在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

6.4.3.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	74,590.88
信息披露费	59,672.34

证券出借违约金	-
指数使用费	10,256,877.11
银行费用	39,689.80
其他	21,270.81
合计	10,452,100.94

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.5 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.5.2 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
南方基金管理股份有限公司("南方基金")	基金管理人
中国农业银行股份有限公司("中国农业银行")	基金托管人
华泰证券股份有限公司("华泰证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司("兴业证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
华泰联合证券有限责任公司("华泰联合")	基金管理人的股东华泰证券控制的公司
南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)("南方中证 500ETF 联接基金")	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 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
华泰证券	74,009,409,771.71	86.28%	37,568,777,319.64	73.97%

6.4.6.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 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
华泰证券	1,051,393.20	7.70%	-	-

6.4.6.1.3 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.6.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 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
华泰证券	7,401,850.47	86.28%	3,421,936.03	79.80%
关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 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
华泰证券	3,757,425.74	73.97%	1,539,220.73	58.16%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算。

2. 该类佣金协议的服务范围符合《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（中国证券监督管理委员会公告（2024）3 号）相关规定。《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》生效后，被动股票型基金不再通过股票交易佣金支付研究服务等其他费用，其他类型基金可以通过股票交易佣金支付研究服务费用。

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	170,947,951.70	128,751,632.93
其中：应支付销售机构的客户维护费	-	-
应支付基金管理人的净管理费	170,947,951.70	128,751,632.93

注：支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.50% ÷ 当年天数。

6.4.6.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	34,189,590.38	25,750,326.59

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

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

6.4.6.3 销售服务费

无。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.6.4 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

6.4.6.4.1 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

本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 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
华泰证券	-	-	-	-

上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 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
华泰证券	17,833,156,084.00	13,232,842.76	556,350.00	554.50

6.4.6.4.2 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

本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	20,713,927,528.00	1~4.3	1.05	9,982,043.62	489,297,506.00	124,401.89

上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日						
---	--	--	--	--	--	--

关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	12,052,771,865.00	1~3.5	1.29	5,797,820.98	2,854,831,100.00	757,203.79

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
华泰证券股份有限公司	59,367,074.00	0.40%	67,918,529.00	0.80%
兴业证券股份有限公司	7,166,333.00	0.05%	16,344,050.00	0.19%
中国农业银行-南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)	1,471,842,076.00	9.96%	1,479,251,580.00	17.48%

注：本基金其他关联方投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

6.4.6.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	122,336,531.06	2,739,983.73	173,782,511.84	1,560,750.92

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行约定利率计息。

6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量 (单位: 股/张)	总金额
华泰联合	688709	成都华微	网下申购	10,448	163,929.12
华泰联合	603341	龙旗科技	网下申购	2,978	77,428.00
华泰联合	301587	中瑞股份	网下申购	3,056	66,406.88

兴业证券	301392	汇成真空	网下申购	2,189	26,705.80
------	--------	------	------	-------	-----------

上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合	113066	平煤转债	配债	92,780	9,278,000.00
华泰联合	688472	阿特斯	网下申购	62,602	694,882.20
华泰联合	688512	慧智微	网下申购	7,209	150,812.28
华泰联合	688478	晶升股份	网下申购	4,013	130,502.76
华泰联合	688429	时创能源	网下申购	3,452	66,278.40
华泰联合	603291	联合水务	网下申购	536	3,140.96
兴业证券	301322	绿通科技	网下申购	2,604	341,410.44
兴业证券	301315	威士顿	网下申购	2,253	72,749.37
兴业证券,华泰联合	688469	中芯集成	网下申购	137,994	785,185.86

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.7 利润分配情况

6.4.7.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

单位：人民币元

序号	权益登记日	场内除息日	场外除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2024 年 5 月 16 日	2024 年 5 月 17 日	-	0.8700	1,206,391,599.28	-	1,206,391,599.28	-
合计	-	-	-	0.8700	1,206,391,599.28	-	1,206,391,599.28	-

6.4.8 期末（2024 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 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

6.4.8.1.1 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
688525	佰维存储	2024 年	6 个月	大宗受	49.72	56.10	500,00	24,860,000.0	28,050,000.0	-

		6月7日		限锁定			0	0	0	
688525	佰维存储	2024年6月12日	6个月	大宗受限锁定	54.20	56.08	500,000	27,100,000.00	28,040,000.00	-
688525	佰维存储	2024年6月11日	6个月	大宗受限锁定	54.37	56.10	300,000	16,311,000.00	16,830,000.00	-
688525	佰维存储	2024年6月11日	6个月	大宗受限锁定	54.31	56.10	200,000	10,862,000.00	11,220,000.00	-
688065	凯赛生物	2024年6月6日	6个月	大宗受限锁定	43.53	42.74	190,000	8,270,700.00	8,120,600.00	-
301589	诺瓦星云	2024年2月1日	6个月	新股锁定期	126.89	188.01	691	87,680.99	129,914.91	-
301589	诺瓦星云	2024年5月30日	1-6个月(含)	锁定期转增	-	188.01	553	-	103,969.53	-
688692	达梦数据	2024年6月4日	6个月	新股锁定期	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	1个月内(含)	新股未上市	18.65	18.65	1,287	24,002.55	24,002.55	-
603350	安乃达	2024年6月26日	1个月内(含)	新股未上市	20.56	20.56	1,051	21,608.56	21,608.56	-
688709	成都华微	2024年1月31日	6个月	新股锁定期	15.69	18.79	1,045	16,396.05	19,635.55	-
301536	星宸科技	2024年3月20日	6个月	新股锁定期	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
688584	上海合晶	2024年2月1日	6个月	新股锁定期	22.66	15.89	866	19,623.56	13,760.74	-
301538	骏鼎达	2024年3月13日	6个月	新股锁定期	55.82	91.24	107	5,972.74	9,762.68	-
301538	骏鼎达	2024年5月22日	1-6个月(含)	锁定期转增	-	91.24	43	-	3,923.32	-

301565	中仑新材	2024 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-
301580	爱迪特	2024 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁 定期	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-
603341	龙旗科技	2024 年 2 月 23 日	6 个月	新股锁 定期	26.00	37.49	298	7,748.00	11,172.02	-
688691	灿芯股份	2024 年 4 月 2 日	6 个月	新股锁 定期	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
301566	达利凯普	2023 年 12 月 22 日	6 个月	新股锁 定期	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301392	汇成真空	2024 年 5 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301591	肯特股份	2024 年 2 月 20 日	6 个月	新股锁 定期	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
301587	中瑞股份	2024 年 3 月 27 日	6 个月	新股锁 定期	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
001389	广合科技	2024 年 3 月 26 日	6 个月	新股锁 定期	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301539	宏鑫科技	2024 年 4 月 3 日	6 个月	新股锁 定期	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
688695	中创股份	2024 年 3 月 6 日	6 个月	新股锁 定期	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688530	欧莱新材	2024 年 4 月 29 日	6 个月	新股锁 定期	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
301588	美新科技	2024 年 3 月 6 日	6 个月	新股锁 定期	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301502	华阳智能	2024 年 1 月 26 日	6 个月	新股锁 定期	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
603325	博隆技术	2024 年 1 月 3	6 个月	新股锁 定期	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-

		日								
603381	永臻股份	2024 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁 定期	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
603344	星德胜	2024 年 3 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
001359	平安电工	2024 年 3 月 19 日	6 个月	新股锁 定期	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
603082	北自科技	2024 年 1 月 23 日	6 个月	新股锁 定期	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
001379	腾达科技	2024 年 1 月 11 日	6 个月	新股锁 定期	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
603375	盛景微	2024 年 1 月 17 日	6 个月	新股锁 定期	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-

6.4.8.1.2 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
113685	升 24 转债	2024 年 6 月 17 日	1 个月 内(含)	配债未 上市	100.0 0	100.0 1	101,63 0	10,163,000.0 0	10,163,757.3 5	-

注：本基金持有的上述流通受限证券，根据中国证监会、证券交易所发布的相关规定，在受限期内不得转让：

1. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2. 基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

3. 基金作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

4. 基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
400174	中天3	2023年8月30日	暂停转让	0.14	尚未复牌	-	18,775,114	31,284,231.12	2,628,515.96	-

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量(单位:股)	期末估值总额
1	300502	新易盛	2024年7月2日 -2024年7月10日	105.55	306,800.00	32,382,740.00
2	002028	思源电气	2024年7月2日 -2024年7月10日	66.90	265,600.00	17,768,640.00
3	601058	赛轮轮胎	2024年7月2日 -2024年7月10日	14.00	1,064,400.00	14,901,600.00
4	688169	石头科技	2024年7月2日 -2024年7月10日	392.60	37,500.00	14,722,500.00
5	002340	格林美	2024年7月2日 -2024年7月10日	6.37	2,215,200.00	14,110,824.00
6	600066	宇通客车	2024年7月2日 -2024年7月10日	25.80	536,700.00	13,846,860.00
7	000933	神火股份	2024年7月2日	20.23	679,700.00	13,750,331.00

			-2024 年 7 月 10 日			
8	000988	华工科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	29.93	433,600.00	12,977,648.00
9	002384	东山精密	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	20.70	626,900.00	12,976,830.00
10	300394	天孚通信	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	88.42	144,000.00	12,732,480.00
11	601077	渝农商行	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	5.02	2,505,000.00	12,575,100.00
12	601168	西部矿业	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	17.95	674,700.00	12,110,865.00
13	600418	江淮汽车	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	15.84	753,300.00	11,932,272.00
14	000423	东阿阿胶	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	62.60	182,700.00	11,437,020.00
15	600157	永泰能源	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	1.18	9,592,500.00	11,319,150.00
16	002625	光启技术	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	17.35	650,800.00	11,291,380.00
17	000630	铜陵有色	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	3.61	3,105,000.00	11,209,050.00
18	600988	赤峰黄金	2024 年 7 月 2 日	16.34	672,900.00	10,995,186.00

			-2024 年 7 月 10 日			
19	601233	桐昆股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	15.96	683,400.00	10,907,064.00
20	002156	通富微电	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	22.39	485,800.00	10,877,062.00
21	002128	电投能源	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	21.10	483,200.00	10,195,520.00
22	002273	水晶光电	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	16.98	600,000.00	10,188,000.00
23	600096	云天化	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	19.42	519,900.00	10,096,458.00
24	002078	太阳纸业	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	13.95	722,800.00	10,083,060.00
25	601567	三星医疗	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 4 日	35.00	285,000.00	9,975,000.00
26	000400	许继电气	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	34.41	288,000.00	9,910,080.00
27	002353	杰瑞股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	35.08	281,800.00	9,885,544.00
28	002223	鱼跃医疗	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	37.60	260,400.00	9,791,040.00
29	002532	天山铝业	2024 年 7 月 2 日	8.11	1,204,000.00	9,764,440.00

			-2024 年 7 月 10 日			
30	300207	欣旺达	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	15.17	642,800.00	9,751,276.00
31	688777	中控技术	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 4 日	37.70	255,000.00	9,613,500.00
32	600398	海澜之家	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	9.24	1,037,500.00	9,586,500.00
33	002138	顺络电子	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	27.46	348,400.00	9,567,064.00
34	601555	东吴证券	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	5.90	1,610,100.00	9,499,590.00
35	002966	苏州银行	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	7.50	1,265,200.00	9,489,000.00
36	600885	宏发股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	27.68	337,200.00	9,333,696.00
37	601128	常熟银行	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	7.57	1,220,100.00	9,236,157.00
38	301236	软通动力	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	35.21	261,800.00	9,217,978.00
39	600765	中航重机	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	20.40	447,700.00	9,133,080.00
40	600352	浙江龙盛	2024 年 7 月 2 日	8.59	1,052,400.00	9,040,116.00

			-2024 年 7 月 10 日			
41	002185	华天科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	8.15	1,104,800.0 0	9,004,120.0 0
42	688617	惠泰医疗	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 4 日	456.10	19,500.00	8,893,950.0 0
43	601108	财通证券	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	6.61	1,313,400.0 0	8,681,574.0 0
44	002738	中矿资源	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	26.80	314,800.00	8,436,640.0 0
45	300003	乐普医疗	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	14.84	567,600.00	8,423,184.0 0
46	300017	网宿科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	7.90	1,052,400.0 0	8,313,960.0 0
47	002517	恺英网络	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	9.55	869,600.00	8,304,680.0 0
48	600879	航天电子	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	7.77	1,067,400.0 0	8,293,698.0 0
49	002409	雅克科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	62.91	130,900.00	8,234,919.0 0
50	300136	信维通信	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	19.58	418,800.00	8,200,104.0 0
51	002281	光迅科技	2024 年 7 月 2 日	37.37	217,600.00	8,131,712.0 0

			-2024 年 7 月 10 日			
52	600873	梅花生物	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	10.02	806,400.00	8,080,128.00
53	002008	大族激光	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	20.80	385,500.00	8,018,400.00
54	688099	晶晨股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	59.32	135,000.00	8,008,200.00
55	600177	雅戈尔	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	7.12	1,123,800.00	8,001,456.00
56	002202	金风科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 4 日	6.72	1,188,800.00	7,988,736.00
57	601577	长沙银行	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	8.18	976,200.00	7,985,316.00
58	002739	万达电影	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	12.09	658,400.00	7,960,056.00
59	689009	九号公司	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	36.81	216,000.00	7,950,960.00
60	600109	国金证券	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	7.55	1,051,200.00	7,936,560.00
61	600079	人福医药	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	17.17	461,700.00	7,927,389.00
62	688120	华海清科	2024 年 7 月 2 日	189.58	41,600.00	7,886,528.00

			-2024 年 7 月 10 日			
63	600060	海信视像	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	24.74	317,400.00	7,852,476.00
64	002465	海格通信	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	10.36	749,600.00	7,765,856.00
65	600536	中国软件	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	29.92	259,200.00	7,755,264.00
66	600497	驰宏锌锗	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	5.34	1,442,100.00	7,700,814.00
67	002444	巨星科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	24.70	311,600.00	7,696,520.00
68	603160	汇顶科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	68.75	111,000.00	7,631,250.00
69	002673	西部证券	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	6.19	1,229,100.00	7,608,129.00
70	603606	东方电缆	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	48.81	155,400.00	7,585,074.00
71	603979	金诚信	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 4 日	50.53	150,000.00	7,579,500.00
72	688122	西部超导	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	38.32	196,500.00	7,529,880.00
73	002436	兴森科技	2024 年 7 月 2 日	10.32	728,000.00	7,512,960.00

			-2024 年 7 月 4 日			
74	300474	景嘉微	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	63.23	118,400.00	7,486,432.00
75	000932	华菱钢铁	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	4.43	1,677,300.00	7,430,439.00
76	002797	第一创业	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	5.09	1,451,200.00	7,386,608.00
77	300054	鼎龙股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 4 日	22.68	323,200.00	7,330,176.00
78	600298	安琪酵母	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	27.93	262,400.00	7,328,832.00
79	300395	菲利华	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	30.75	238,000.00	7,318,500.00
80	300012	华测检测	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	10.06	727,200.00	7,315,632.00
81	000066	中国长城	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	8.75	835,900.00	7,314,125.00
82	000683	远兴能源	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	6.91	1,057,800.00	7,309,398.00
83	600985	淮北矿业	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	16.74	436,200.00	7,301,988.00
84	002432	九安医疗	2024 年 7 月 2 日	40.54	179,800.00	7,289,092.00

			-2024 年 7 月 10 日			
85	600348	华阳股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	9.96	730,200.00	7,272,792.00
86	601666	平煤股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	11.20	641,300.00	7,182,560.00
87	000009	中国宝安	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	8.60	834,900.00	7,180,140.00
88	601179	中国西电	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	8.04	885,800.00	7,121,832.00
89	603596	伯特利	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	38.90	182,400.00	7,095,360.00
90	000878	云南铜业	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	12.46	567,900.00	7,076,034.00
91	600642	申能股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	8.83	791,700.00	6,990,711.00
92	000831	中国稀土	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	25.35	274,900.00	6,968,715.00
93	601615	明阳智能	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 4 日	9.44	735,000.00	6,938,400.00
94	300866	安克创新	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	71.21	96,900.00	6,900,249.00
95	000039	中集集团	2024 年 7 月 2 日	9.26	744,900.00	6,897,774.00

			-2024 年 7 月 10 日			
96	601990	南京证券	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	7.68	893,700.00	6,863,616.00
97	300002	神州泰岳	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 4 日	8.12	843,200.00	6,846,784.00
98	600529	山东药玻	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	25.34	268,200.00	6,796,188.00
99	600839	四川长虹	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	4.49	1,495,500.00	6,714,795.00
100	688525	佰维存储	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 4 日	64.15	103,500.00	6,639,525.00
101	002595	豪迈科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	38.17	172,400.00	6,580,508.00
102	603338	浙江鼎力	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	60.42	108,800.00	6,573,696.00
103	002155	湖南黄金	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	18.10	362,800.00	6,566,680.00
104	300037	新宙邦	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	28.56	228,400.00	6,523,104.00
105	688188	柏楚电子	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	184.55	35,200.00	6,496,160.00
106	300724	捷佳伟创	2024 年 7 月 2 日	54.01	120,000.00	6,481,200.00

			-2024 年 7 月 10 日			
107	000783	长江证券	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	4.83	1,340,100.00	6,472,683.00
108	601717	郑煤机	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	14.80	436,500.00	6,460,200.00
109	603816	顾家家居	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	32.29	199,500.00	6,441,855.00
110	000728	国元证券	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	6.06	1,060,200.00	6,424,812.00
111	000738	航发控制	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	20.07	319,500.00	6,412,365.00
112	002472	双环传动	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	22.02	291,200.00	6,412,224.00
113	300001	特锐德	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	20.12	318,400.00	6,406,208.00
114	002984	森麒麟	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 4 日	24.09	265,600.00	6,398,304.00
115	002294	信立泰	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	26.63	240,000.00	6,391,200.00
116	600862	中航高科	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	18.78	338,700.00	6,360,786.00
117	300073	当升科技	2024 年 7 月 2 日	34.31	185,300.00	6,357,643.00

			-2024 年 7 月 10 日			
118	688180	君实生物	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	29.05	217,200.00	6,309,660.00
119	000703	恒逸石化	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	7.09	889,200.00	6,304,428.00
120	002407	多氟多	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	12.23	514,800.00	6,296,004.00
121	601198	东兴证券	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	7.96	783,900.00	6,239,844.00
122	300699	光威复材	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	24.83	251,200.00	6,237,296.00
123	002850	科达利	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	76.38	81,600.00	6,232,608.00
124	601997	贵阳银行	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	5.27	1,182,600.00	6,232,302.00
125	002756	永兴材料	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	35.78	173,400.00	6,204,252.00
126	000960	锡业股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	15.49	400,200.00	6,199,098.00
127	002262	恩华药业	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	23.74	260,800.00	6,191,392.00
128	002195	岩山科技	2024 年 7 月 2 日	2.51	2,462,000.00	6,179,620.00

			-2024 年 7 月 10 日			
129	600895	张江高科	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	18.48	334,100.00	6,174,168.00
130	301358	湖南裕能	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 4 日	31.46	195,200.00	6,140,992.00
131	002064	华峰化学	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	7.17	856,000.00	6,137,520.00
132	300114	中航电测	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	45.25	135,600.00	6,135,900.00
133	300285	国瓷材料	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	17.85	343,600.00	6,133,260.00
134	603345	安井食品	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 4 日	74.31	82,500.00	6,130,575.00
135	601696	中银证券	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	9.08	674,400.00	6,123,552.00
136	600521	华海药业	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	17.05	359,100.00	6,122,655.00
137	600863	内蒙华电	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	4.64	1,317,600.00	6,113,664.00
138	600038	中直股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	41.11	148,200.00	6,092,502.00
139	603589	口子窖	2024 年 7 月 2 日	39.19	155,200.00	6,082,288.00

			-2024 年 7 月 10 日			
140	000921	海信家电	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 4 日	32.24	187,500.00	6,045,000.00
141	603939	益丰药房	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	24.55	245,700.00	6,031,935.00
142	300146	汤臣倍健	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	13.55	441,200.00	5,978,260.00
143	600141	兴发集团	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	19.08	312,000.00	5,952,960.00
144	600549	厦门钨业	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	17.25	344,700.00	5,946,075.00
145	600699	均胜电子	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	14.82	398,700.00	5,908,734.00
146	600546	山煤国际	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	14.62	401,700.00	5,872,854.00
147	300058	蓝色光标	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	5.44	1,072,400.00	5,833,856.00
148	600820	隧道股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	6.53	891,600.00	5,822,148.00
149	002385	大北农	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	3.85	1,510,600.00	5,815,810.00
150	600369	西南证券	2024 年 7 月 2 日	3.58	1,613,100.00	5,774,898.00

			-2024 年 7 月 10 日			
151	600872	中炬高新	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 4 日	22.69	253,500.00	5,751,915.00
152	000021	深科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	15.12	378,900.00	5,728,968.00
153	601162	天风证券	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	2.18	2,615,400.00	5,701,572.00
154	300529	健帆生物	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	27.21	209,200.00	5,692,332.00
155	600118	中国卫星	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	22.23	255,700.00	5,684,211.00
156	600021	上海电力	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	9.89	570,900.00	5,646,201.00
157	002558	巨人网络	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	9.44	596,400.00	5,630,016.00
158	601000	唐山港	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	4.70	1,197,600.00	5,628,720.00
159	603087	甘李药业	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 4 日	46.32	121,500.00	5,627,880.00
160	002152	广电运通	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	10.46	535,600.00	5,602,376.00
161	600486	扬农化工	2024 年 7 月 2 日	56.45	99,000.00	5,588,550.00

			-2024 年 7 月 10 日			
162	000513	丽珠集团	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	37.21	149,700.00	5,570,337.00
163	300677	英科医疗	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	26.81	207,400.00	5,560,394.00
164	002025	航天电器	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	46.38	118,400.00	5,491,392.00
165	601966	玲珑轮胎	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	18.37	298,200.00	5,477,934.00
166	300373	扬杰科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	38.90	140,800.00	5,477,120.00
167	600704	物产中大	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	4.34	1,259,400.00	5,465,796.00
168	002439	启明星辰	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	17.26	316,400.00	5,461,064.00
169	300144	宋城演艺	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	8.03	678,400.00	5,447,552.00
170	600153	建发股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	8.93	607,200.00	5,422,296.00
171	603179	新泉股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 4 日	39.24	138,000.00	5,415,120.00
172	600155	华创云信	2024 年 7 月 2 日	5.91	915,900.00	5,412,969.00

			-2024 年 7 月 10 日			
173	000830	鲁西化工	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	11.59	465,000.00	5,389,350.00
174	688065	凯赛生物	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 4 日	45.39	118,500.00	5,378,715.00
175	605358	立昂微	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	23.14	232,000.00	5,368,480.00
176	000723	美锦能源	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	4.76	1,119,700.00	5,329,772.00
177	300251	光线传媒	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	8.41	633,200.00	5,325,212.00
178	000519	中兵红箭	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	14.67	361,000.00	5,295,870.00
179	600583	海油工程	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	5.91	894,600.00	5,287,086.00
180	688390	固德威	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	56.12	93,840.00	5,266,300.80
181	300383	光环新网	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	8.45	619,200.00	5,232,240.00
182	000591	太阳能	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	4.71	1,109,100.00	5,223,861.00
183	000636	风华高科	2024 年 7 月 2 日	13.06	399,700.00	5,220,082.00

			-2024 年 7 月 10 日			
184	601156	东航物流	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	20.35	256,500.00	5,219,775.00
185	300024	机器人	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	9.74	534,000.00	5,201,160.00
186	000623	吉林敖东	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	13.40	386,700.00	5,181,780.00
187	600970	中材国际	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	12.06	427,200.00	5,152,032.00
188	002958	青农商行	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	2.68	1,914,000.00	5,129,520.00
189	002044	美年健康	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	3.78	1,350,400.00	5,104,512.00
190	600380	健康元	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	11.17	453,900.00	5,070,063.00
191	300118	东方日升	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	12.10	417,800.00	5,055,380.00
192	601216	君正集团	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	3.69	1,367,100.00	5,044,599.00
193	000729	燕京啤酒	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	8.83	569,400.00	5,027,802.00
194	000629	钒钛股份	2024 年 7 月 2 日	2.50	2,009,100.00	5,022,750.00

			-2024 年 7 月 10 日			
195	600143	金发科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	6.61	756,000.00	4,997,160.00
196	600998	九州通	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	4.88	1,022,100.00	4,987,848.00
197	600282	南钢股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	4.98	999,900.00	4,979,502.00
198	300088	长信科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	4.70	1,058,000.00	4,972,600.00
199	600637	东方明珠	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	6.08	816,900.00	4,966,752.00
200	601456	国联证券	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	9.64	515,200.00	4,966,528.00
201	600170	上海建工	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	2.15	2,303,800.00	4,953,170.00
202	600516	方大炭素	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	4.31	1,139,700.00	4,912,107.00
203	600392	盛和资源	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	8.62	566,700.00	4,884,954.00
204	600763	通策医疗	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 4 日	54.05	90,000.00	4,864,500.00
205	601933	永辉超市	2024 年 7 月 2 日	2.48	1,957,500.00	4,854,600.00

			-2024 年 7 月 10 日			
206	002120	韵达股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	7.74	624,800.00	4,835,952.00
207	000818	航锦科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 4 日	22.08	219,000.00	4,835,520.00
208	601991	大唐发电	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	3.01	1,605,800.00	4,833,458.00
209	600909	华安证券	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	4.21	1,143,300.00	4,813,293.00
210	601665	齐鲁银行	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	4.91	978,300.00	4,803,453.00
211	300567	精测电子	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 4 日	56.51	84,800.00	4,792,048.00
212	002261	拓维信息	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 4 日	11.07	432,000.00	4,782,240.00
213	600008	首创环保	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	2.68	1,782,900.00	4,778,172.00
214	603000	人民网	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	19.99	238,400.00	4,765,616.00
215	000883	湖北能源	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	6.01	792,900.00	4,765,329.00
216	300568	星源材质	2024 年 7 月 2 日	8.20	580,000.00	4,756,000.00

			-2024 年 7 月 10 日			
217	600566	济川药业	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	31.71	149,700.00	4,746,987.00
218	002624	完美世界	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	7.60	623,500.00	4,738,600.00
219	688213	思特威	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 4 日	48.50	97,500.00	4,728,750.00
220	002430	杭氧股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	22.25	212,400.00	4,725,900.00
221	002497	雅化集团	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	8.92	528,300.00	4,712,436.00
222	002429	兆驰股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	4.81	978,000.00	4,704,180.00
223	600511	国药股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	30.79	152,700.00	4,701,633.00
224	601016	节能风电	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	2.99	1,570,500.00	4,695,795.00
225	600867	通化东宝	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	8.37	561,000.00	4,695,570.00
226	603156	养元饮品	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	21.27	218,900.00	4,656,003.00
227	002939	长城证券	2024 年 7 月 2 日	6.70	694,400.00	4,652,480.00

			-2024 年 7 月 10 日			
228	000997	新大陆	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	13.91	334,200.00	4,648,722.00
229	603658	安图生物	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	46.07	100,800.00	4,643,856.00
230	603228	景旺电子	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	31.80	145,600.00	4,630,080.00
231	600582	天地科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	6.89	668,700.00	4,607,343.00
232	601231	环旭电子	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	16.05	286,100.00	4,591,905.00
233	600498	烽火通信	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	15.90	288,000.00	4,579,200.00
234	600535	天士力	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	12.58	362,700.00	4,562,766.00
235	300765	新诺威	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 4 日	25.23	180,800.00	4,561,584.00
236	600129	太极集团	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	28.92	157,500.00	4,554,900.00
237	603927	中科软	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	18.09	251,200.00	4,544,208.00
238	300487	蓝晓科技	2024 年 7 月 2 日	41.76	108,800.00	4,543,488.00

			-2024 年 7 月 10 日			
239	000598	兴蓉环境	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	7.52	603,300.00	4,536,816.00
240	600004	白云机场	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	9.48	478,200.00	4,533,336.00
241	002508	老板电器	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	22.10	204,800.00	4,526,080.00
242	300601	康泰生物	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	15.61	289,200.00	4,514,412.00
243	600580	卧龙电驱	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	12.15	371,400.00	4,512,510.00
244	000750	国海证券	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	2.91	1,550,100.00	4,510,791.00
245	000060	中金岭南	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	4.24	1,058,700.00	4,488,888.00
246	002368	太极股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	22.55	198,900.00	4,485,195.00
247	002372	伟星新材	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	15.42	290,700.00	4,482,594.00
248	002926	华西证券	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	6.59	679,200.00	4,475,928.00
249	688052	纳芯微	2024 年 7 月 2 日	102.78	43,200.00	4,440,096.00

			-2024 年 7 月 10 日			
250	002653	海思科	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	30.70	144,000.00	4,420,800.00
251	300253	卫宁健康	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	5.90	746,800.00	4,406,120.00
252	002299	圣农发展	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	13.64	322,800.00	4,402,992.00
253	300604	长川科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	27.17	161,600.00	4,390,672.00
254	603486	科沃斯	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 4 日	47.18	93,000.00	4,387,740.00
255	002065	东华软件	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	4.52	969,200.00	4,380,784.00
256	600166	福田汽车	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	2.25	1,945,200.00	4,376,700.00
257	002500	山西证券	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	4.70	930,000.00	4,371,000.00
258	002056	横店东磁	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	12.47	350,400.00	4,369,488.00
259	002414	高德红外	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	5.89	738,400.00	4,349,176.00
260	600325	华发股份	2024 年 7 月 2 日	6.50	668,400.00	4,344,600.00

			-2024 年 7 月 10 日			
261	688772	珠海冠宇	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	14.90	291,500.00	4,343,350.00
262	300390	天华新能	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	17.18	252,800.00	4,343,104.00
263	600373	中文传媒	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	14.84	292,500.00	4,340,700.00
264	600655	豫园股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	5.15	841,300.00	4,332,695.00
265	300763	锦浪科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 4 日	41.64	104,000.00	4,330,560.00
266	300009	安科生物	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	8.54	506,800.00	4,328,072.00
267	600673	东阳光	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	7.04	610,200.00	4,295,808.00
268	600499	科达制造	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	8.43	505,400.00	4,260,522.00
269	603893	瑞芯微	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	59.17	72,000.00	4,260,240.00
270	603568	伟明环保	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	20.58	206,700.00	4,253,886.00
271	002507	涪陵榨菜	2024 年 7 月 2 日	12.25	347,200.00	4,253,200.00

			-2024 年 7 月 10 日			
272	688114	华大智造	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	47.41	89,600.00	4,247,936.00
273	000893	亚钾国际	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	16.16	262,500.00	4,242,000.00
274	600754	锦江酒店	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 4 日	22.98	184,500.00	4,239,810.00
275	601611	中国核建	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	8.09	522,900.00	4,230,261.00
276	000027	深圳能源	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	7.30	578,100.00	4,220,130.00
277	601636	旗滨集团	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	6.45	652,200.00	4,206,690.00
278	600563	法拉电子	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	76.18	55,200.00	4,205,136.00
279	000998	隆平高科	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	9.83	425,700.00	4,184,631.00
280	603298	杭叉集团	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 4 日	19.64	211,500.00	4,153,860.00
281	600737	中粮糖业	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	9.59	431,700.00	4,140,003.00
282	601866	中远海发	2024 年 7 月 2 日	2.58	1,603,200.00	4,136,256.00

			-2024 年 7 月 10 日			
283	002203	海亮股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	7.98	518,000.00	4,133,640.00
284	603290	斯达半导	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 4 日	86.11	48,000.00	4,133,280.00
285	603077	和邦生物	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	1.65	2,498,400.00	4,122,360.00
286	600131	国网信通	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	16.87	244,200.00	4,119,654.00
287	002831	裕同科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	25.59	160,000.00	4,094,400.00
288	600755	厦门国贸	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	7.17	570,900.00	4,093,353.00
289	601958	金钼股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	10.41	391,500.00	4,075,515.00
290	688002	睿创微纳	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	27.97	145,200.00	4,061,244.00
291	688385	复旦微电	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	31.38	129,000.00	4,048,020.00
292	002572	索菲亚	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	15.33	263,900.00	4,045,587.00
293	002487	大金重工	2024 年 7 月 2 日	22.88	176,400.00	4,036,032.00

			-2024 年 7 月 10 日			
294	688521	芯原股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	26.75	150,400.00	4,023,200.00
295	600859	王府井	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	11.74	342,400.00	4,019,776.00
296	600329	达仁堂	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	32.39	123,200.00	3,990,448.00
297	601880	辽港股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	1.23	3,242,200.00	3,987,906.00
298	600801	华新水泥	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	13.75	289,600.00	3,982,000.00
299	001286	陕西能源	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	11.53	344,300.00	3,969,779.00
300	002240	盛新锂能	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	13.42	295,800.00	3,969,636.00
301	002080	中材科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	12.90	307,700.00	3,969,330.00
302	002683	广东宏大	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	20.13	196,800.00	3,961,584.00
303	600707	彩虹股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	6.81	581,700.00	3,961,377.00
304	600884	杉杉股份	2024 年 7 月 2 日	8.12	487,700.00	3,960,124.00

			-2024 年 7 月 10 日			
305	002373	千方科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	9.07	434,400.00	3,940,008.00
306	603885	吉祥航空	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	10.99	358,200.00	3,936,618.00
307	300070	碧水源	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	4.19	939,200.00	3,935,248.00
308	300296	利亚德	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	4.50	873,600.00	3,931,200.00
309	002936	郑州银行	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	1.73	2,271,000.00	3,928,830.00
310	002019	亿帆医药	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	12.36	316,800.00	3,915,648.00
311	002506	协鑫集成	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	1.94	2,016,000.00	3,911,040.00
312	000887	中鼎股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	12.24	319,500.00	3,910,680.00
313	002244	滨江集团	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	7.26	538,400.00	3,908,784.00
314	600435	北方导航	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	8.62	452,500.00	3,900,550.00
315	603379	三美股份	2024 年 7 月 2 日	39.14	99,000.00	3,874,860.00

			-2024 年 7 月 10 日			
316	300803	指南针	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 4 日	36.41	105,600.00	3,844,896.00
317	300748	金力永磁	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	12.96	296,000.00	3,836,160.00
318	603225	新凤鸣	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	15.59	246,000.00	3,835,140.00
319	002568	百润股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	16.83	227,200.00	3,823,776.00
320	600901	江苏金租	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	5.05	753,000.00	3,802,650.00
321	000155	川能动力	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	10.77	351,700.00	3,787,809.00
322	300676	华大基因	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	35.01	107,200.00	3,753,072.00
323	600416	湘电股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	9.94	376,200.00	3,739,428.00
324	600995	南网储能	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	9.66	386,700.00	3,735,522.00
325	002557	洽洽食品	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	28.19	131,200.00	3,698,528.00
326	600390	五矿资本	2024 年 7 月 2 日	4.05	912,900.00	3,697,245.00

			-2024 年 7 月 10 日			
327	002268	电科网安	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	14.23	255,600.00	3,637,188.00
328	300595	欧普康视	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	15.68	231,600.00	3,631,488.00
329	600739	辽宁成大	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	8.37	433,200.00	3,625,884.00
330	603883	老百姓	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	18.36	197,210.00	3,620,775.60
331	600483	福能股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 4 日	11.66	310,500.00	3,620,430.00
332	000050	深天马 A	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	7.28	496,500.00	3,614,520.00
333	601098	中南传媒	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	12.42	290,700.00	3,610,494.00
334	601928	凤凰传媒	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	10.96	329,300.00	3,609,128.00
335	600598	北大荒	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	12.49	288,000.00	3,597,120.00
336	688301	奕瑞科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	115.23	31,180.00	3,592,871.40
337	601598	中国外运	2024 年 7 月 2 日	5.63	637,200.00	3,587,436.00

			-2024 年 7 月 10 日			
338	600399	抚顺特钢	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	5.63	637,200.00	3,587,436.00
339	600258	首旅酒店	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	12.35	288,000.00	3,556,800.00
340	300558	贝达药业	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	32.55	108,800.00	3,541,440.00
341	600848	上海临港	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	9.11	387,900.00	3,533,769.00
342	002531	天顺风能	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	8.94	387,200.00	3,461,568.00
343	600977	中国电影	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	10.76	321,300.00	3,457,188.00
344	002408	齐翔腾达	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	5.60	613,600.00	3,436,160.00
345	600378	昊华科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	28.90	118,400.00	3,421,760.00
346	688005	容百科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	23.28	146,900.00	3,419,832.00
347	000563	陕国投 A	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	2.75	1,243,200.00	3,418,800.00
348	603444	吉比特	2024 年 7 月 2 日	178.01	19,200.00	3,417,792.00

			-2024 年 7 月 10 日			
349	688536	思瑞浦	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	97.81	34,900.00	3,413,569.00
350	603712	七一二	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	18.19	187,500.00	3,410,625.00
351	600968	海油发展	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	4.12	821,400.00	3,384,168.00
352	603858	步长制药	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	15.15	223,200.00	3,381,480.00
353	000778	新兴铸管	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	3.48	969,000.00	3,372,120.00
354	601118	海南橡胶	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	4.55	738,900.00	3,361,995.00
355	300212	易华录	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	16.83	198,500.00	3,340,755.00
356	601212	白银有色	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 4 日	2.78	1,198,500.00	3,331,830.00
357	688017	绿的谐波	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 4 日	82.10	40,500.00	3,325,050.00
358	688538	和辉光电	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	1.98	1,679,100.00	3,324,618.00
359	603737	三棵树	2024 年 7 月 2 日	36.27	91,200.00	3,307,824.00

			-2024 年 7 月 10 日			
360	603882	金城医学	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	27.19	121,600.00	3,306,304.00
361	600271	航天信息	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	7.36	448,800.00	3,303,168.00
362	600528	中铁工业	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	7.32	449,400.00	3,289,608.00
363	600062	华润双鹤	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	19.58	168,000.00	3,289,440.00
364	600056	中国医药	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	10.12	323,200.00	3,270,784.00
365	000709	河钢股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	1.94	1,674,300.00	3,248,142.00
366	601155	新城控股	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 4 日	8.87	366,000.00	3,246,420.00
367	603688	石英股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	29.61	109,500.00	3,242,295.00
368	688234	天岳先进	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	46.92	69,000.00	3,237,480.00
369	688200	华峰测控	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	91.75	35,200.00	3,229,600.00
370	000739	普洛药业	2024 年 7 月 2 日	13.57	237,000.00	3,216,090.00

			-2024 年 7 月 10 日			
371	600959	江苏有线	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	2.64	1,215,900.0 0	3,209,976.0 0
372	688220	翱捷科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	37.46	85,200.00	3,191,592.0 0
373	002266	浙富控股	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	2.79	1,127,200.0 0	3,144,888.0 0
374	000825	太钢不锈	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	3.38	922,800.00	3,119,064.0 0
375	688331	荣昌生物	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	43.20	72,000.00	3,110,400.0 0
376	603650	彤程新材	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	29.55	104,000.00	3,073,200.0 0
377	002607	中公教育	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	1.53	1,976,600.0 0	3,024,198.0 0
378	000987	越秀资本	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	4.96	608,100.00	3,016,176.0 0
379	601399	国机重装	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 4 日	2.58	1,167,000.0 0	3,010,860.0 0
380	600906	财达证券	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	5.73	524,400.00	3,004,812.0 0
381	603456	九洲药业	2024 年 7 月 2 日	13.72	218,700.00	3,000,564.0 0

			-2024 年 7 月 10 日			
382	600517	国网英大	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	4.33	691,800.00	2,995,494.00
383	002670	国盛金控	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	8.47	353,600.00	2,994,992.00
384	601019	山东出版	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 4 日	11.82	252,000.00	2,978,640.00
385	002423	中粮资本	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	7.49	396,800.00	2,972,032.00
386	600612	老凤祥	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 4 日	58.19	51,000.00	2,967,690.00
387	300438	鹏辉能源	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	18.34	161,500.00	2,961,910.00
388	688063	派能科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	39.71	73,920.00	2,935,363.20
389	600208	新湖中宝	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	1.58	1,835,600.00	2,900,248.00
390	688297	中无人机	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	33.03	87,700.00	2,896,731.00
391	600316	洪都航空	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	16.63	174,000.00	2,893,620.00
392	601298	青岛港	2024 年 7 月 2 日	9.56	302,400.00	2,890,944.00

			-2024 年 7 月 10 日			
393	000937	冀中能源	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	6.70	430,200.00	2,882,340.00
394	600871	石化油服	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	1.74	1,645,800.00	2,863,692.00
395	688567	孚能科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	9.60	296,700.00	2,848,320.00
396	600022	山东钢铁	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	1.22	2,301,700.00	2,808,074.00
397	300888	稳健医疗	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	25.30	108,400.00	2,742,520.00
398	300357	我武生物	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	20.22	135,600.00	2,741,832.00
399	000032	深桑达 A	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 4 日	14.98	183,000.00	2,741,340.00
400	601106	中国一重	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	2.31	1,186,700.00	2,741,277.00
401	688032	禾迈股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	114.78	23,840.00	2,736,355.20
402	601965	中国汽研	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 4 日	16.89	162,000.00	2,736,180.00
403	600098	广州发展	2024 年 7 月 2 日	6.40	426,000.00	2,726,400.00

			-2024 年 7 月 4 日			
404	300776	帝尔激光	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	45.96	59,200.00	2,720,832.00
405	600377	宁沪高速	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	12.60	213,100.00	2,685,060.00
406	601608	中信重工	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	3.81	701,700.00	2,673,477.00
407	002690	美亚光电	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	16.50	161,500.00	2,664,750.00
408	600663	陆家嘴	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	8.82	301,200.00	2,656,584.00
409	603233	大参林	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	14.30	184,200.00	2,634,060.00
410	688516	奥特维	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	41.81	63,000.00	2,634,030.00
411	600578	京能电力	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 4 日	3.24	811,500.00	2,629,260.00
412	688561	奇安信	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 4 日	23.62	111,000.00	2,621,820.00
413	600350	山东高速	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	8.85	292,800.00	2,591,280.00
414	600315	上海家化	2024 年 7 月 2 日	17.78	145,600.00	2,588,768.00

			-2024 年 7 月 10 日			
415	688349	三一重能	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	24.84	104,000.00	2,583,360.00
416	600827	百联股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	7.38	346,600.00	2,557,908.00
417	003031	中瓷电子	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	46.24	55,100.00	2,547,824.00
418	600500	中化国际	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	3.49	725,400.00	2,531,646.00
419	003022	联泓新科	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	13.71	183,600.00	2,517,156.00
420	603707	健友股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	11.88	209,300.00	2,486,484.00
421	603517	绝味食品	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	15.40	161,300.00	2,484,020.00
422	603529	爱玛科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	27.33	90,700.00	2,478,831.00
423	600967	内蒙一机	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	7.20	343,800.00	2,475,360.00
424	601992	金隅集团	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	1.37	1,800,400.00	2,466,548.00
425	603826	坤彩科技	2024 年 7 月 2 日	28.97	85,120.00	2,465,926.40

			-2024 年 7 月 10 日			
426	002867	周大生	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	13.06	188,400.00	2,460,504.00
427	000958	电投产融	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	3.66	652,200.00	2,387,052.00
428	300682	朗新集团	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	8.51	280,400.00	2,386,204.00
429	000559	万向钱潮	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	4.46	534,300.00	2,382,978.00
430	688425	铁建重工	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	3.68	647,100.00	2,381,328.00
431	601568	北元集团	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	3.71	641,700.00	2,380,707.00
432	000156	华数传媒	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	6.28	376,200.00	2,362,536.00
433	688029	南微医学	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	61.56	37,500.00	2,308,500.00
434	003035	南网能源	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	4.40	522,400.00	2,298,560.00
435	603218	日月股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	10.27	223,400.00	2,294,318.00
436	688520	神州细胞	2024 年 7 月 2 日	39.35	57,600.00	2,266,560.00

			-2024 年 7 月 10 日			
437	600481	双良节能	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	4.67	484,800.00	2,264,016.00
438	301267	华夏眼科	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 4 日	20.72	108,800.00	2,254,336.00
439	600126	杭钢股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	4.11	546,900.00	2,247,759.00
440	000537	中绿电	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	9.53	234,900.00	2,238,597.00
441	000898	鞍钢股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	2.12	1,029,800.00	2,183,176.00
442	000967	盈峰环境	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	4.23	514,500.00	2,176,335.00
443	688248	南网科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	29.63	73,300.00	2,171,879.00
444	688475	萤石网络	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 4 日	34.11	63,000.00	2,148,930.00
445	688281	华秦科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	83.32	25,600.00	2,132,992.00
446	603786	科博达	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	64.15	33,000.00	2,116,950.00
447	600032	浙江新能	2024 年 7 月 2 日	7.28	290,700.00	2,116,296.00

			-2024 年 7 月 10 日			
448	600339	中油工程	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	3.12	675,900.00	2,108,808.00
449	688778	厦钨新能	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	31.24	67,500.00	2,108,700.00
450	001872	招商港口	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	19.25	107,100.00	2,061,675.00
451	600095	湘财股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	5.96	345,000.00	2,056,200.00
452	002608	江苏国信	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	7.75	263,900.00	2,045,225.00
453	002153	石基信息	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	5.73	354,800.00	2,033,004.00
454	603127	昭衍新药	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	13.27	152,700.00	2,026,329.00
455	002563	森马服饰	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	5.81	348,000.00	2,021,880.00
456	603185	弘元绿能	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	17.09	118,100.00	2,018,329.00
457	600808	马钢股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	2.02	968,700.00	1,956,774.00
458	000539	粤电力 A	2024 年 7 月 2 日	5.08	382,700.00	1,944,116.00

			-2024 年 7 月 10 日			
459	688779	五矿新能	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	4.63	415,400.00	1,923,302.00
460	002518	科士达	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	17.70	108,400.00	1,918,680.00
461	601228	广州港	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	3.05	611,400.00	1,864,770.00
462	000959	首钢股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	2.72	671,400.00	1,826,208.00
463	600764	中国海防	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	19.63	92,500.00	1,815,775.00
464	600928	西安银行	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	3.27	540,300.00	1,766,781.00
465	000401	冀东水泥	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	4.06	428,700.00	1,740,522.00
466	688006	杭可科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	17.45	97,500.00	1,701,375.00
467	603056	德邦股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	13.10	124,500.00	1,630,950.00
468	300861	美畅股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	19.35	83,200.00	1,609,920.00
469	603305	旭升集团	2024 年 7 月 2 日	10.56	151,500.00	1,599,840.00

			-2024 年 7 月 10 日			
470	600299	安迪苏	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	9.70	162,300.00	1,574,310.00
471	301029	怡合达	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	19.66	79,900.00	1,570,834.00
472	688172	燕东微	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 4 日	16.18	96,000.00	1,553,280.00
473	601139	深圳燃气	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	6.68	232,200.00	1,551,096.00
474	002791	坚朗五金	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	25.87	59,100.00	1,528,917.00
475	688387	信科移动	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	5.04	296,700.00	1,495,368.00
476	688276	百克生物	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	28.37	50,700.00	1,438,359.00
477	688819	天能股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	23.86	58,900.00	1,405,354.00
478	688375	国博电子	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	70.64	19,500.00	1,377,480.00
479	603317	天味食品	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	11.41	120,700.00	1,377,187.00
480	688107	安路科技	2024 年 7 月 2 日	25.42	51,200.00	1,301,504.00

			-2024 年 7 月 10 日			
481	688153	唯捷创芯	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	37.00	34,200.00	1,265,400.00
482	000031	大悦城	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	2.34	518,100.00	1,212,354.00
483	601858	中国科传	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 4 日	19.12	63,000.00	1,204,560.00
484	601828	美凯龙	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	2.55	470,800.00	1,200,540.00
485	601158	重庆水务	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	4.80	249,600.00	1,198,080.00
486	002945	华林证券	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	9.98	116,400.00	1,161,672.00
487	688348	昱能科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	59.00	19,200.00	1,132,800.00
488	600956	新天绿能	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	8.17	125,700.00	1,026,969.00
489	301165	锐捷网络	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 4 日	29.84	30,400.00	907,136.00
490	688295	中复神鹰	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	20.30	40,200.00	816,060.00
491	603868	飞科电器	2024 年 7 月 2 日	38.40	19,500.00	748,800.00

			-2024 年 7 月 10 日			
合计	-	-	-	-	264,847,710.00	2,471,291,568.60

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

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金，紧密跟踪中证 500 指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪中证 500 指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

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

6.4.9.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人开立的托管账户或其他大中型商业银行开立的存款账户，因

而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金净资产的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金为履行与金融负债有关的义务而调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，可能产生基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的进行期货投资，以对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

于本期末，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息。本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。

此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产净值的 15%。于本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合该要求。

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

6.4.9.4 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。

6.4.9.4.1 利率风险

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

本基金持有的利率敏感性资产存在相应的利率风险。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。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	122,336,531.06	-	-	-	122,336,531.06
结算备付金	1,414,547,494.42	-	-	-	1,414,547,494.42
存出保证金	26,386,038.29	-	-	191,892,460.80	218,278,499.09
交易性金融	-	-	10,163,757.3	72,274,850.9	72,285,014.6

资产			5	25.66	83.01
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	69,658,126.10	69,658,126.10
应收股利	-	-	-	4,018,970.51	4,018,970.51
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	1,009,995.59	1,009,995.59
资产总计	1,563,270,063.77	-	10,163,757.35	72,541,430,478.66	74,114,864,299.78
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	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	29,447,626.52	29,447,626.52
应付托管费	-	-	-	5,889,525.32	5,889,525.32
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	147,237.19	147,237.19
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	187,556,919.79	187,556,919.79
负债总计	-	-	-	223,041,308.	223,041,308.

				82	82
利率敏感度缺口	1,563,270,063.77	-	10,163,757.35	72,318,389.169.84	73,891,822.990.96
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	805,318,888.56	-	-	-	805,318,888.56
结算备付金	707,749,719.50	-	-	-	707,749,719.50
存出保证金	14,437,190.48	-	-	193,527,076.80	207,964,267.28
交易性金融资产	-	-	-	45,121,518.598.67	45,121,518.598.67
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	33,919,719.37	33,919,719.37
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	2,773,094.59	2,773,094.59
资产总计	1,527,505,798.54	-	-	45,351,738.489.43	46,879,244.287.97
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	-	-	-	79,363.72	79,363.72
应付赎回款	-	-	-	-	-

应付管理人报酬	-	-	-	18,660,575.39	18,660,575.39
应付托管费	-	-	-	3,732,115.08	3,732,115.08
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	242,497.39	242,497.39
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	108,303,277.13	108,303,277.13
负债总计	-	-	-	131,017,828.71	131,017,828.71
利率敏感度缺口	1,527,505,798.54	-	-	45,220,720,660.72	46,748,226,459.26

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

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	1.市场利率平行上升25个基点	0.00	0.00
2.市场利率平行下降25个基点	0.00	0.00	

6.4.9.4.2 外汇风险

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

6.4.9.4.3 其他价格风险

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

本基金采用完全复制法，跟踪中证 500 指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中，中证 500 指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产净值的 95%。此外，

本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	72,274,850,925.66	97.81	45,121,518,598.67	96.52
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	72,274,850,925.66	97.81	45,121,518,598.67	96.52

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资。在当日无负债结算制度下，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。

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	1.组合自身基准上升 5%	3,673,262,353.76	2,322,371,395.03
2.组合自身基准下降 5%	-3,673,262,353.76	-2,322,371,395.03	

6.4.10 公允价值

6.4.10.1 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。

6.4.10.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.10.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日
第一层次	72,179,443,263.25
第二层次	10,209,368.46
第三层次	95,362,051.30
合计	72,285,014,683.01

6.4.10.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.10.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.10.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.11 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	72,274,850,925.66	97.52
	其中：股票	72,274,850,925.66	97.52
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,163,757.35	0.01
	其中：债券	10,163,757.35	0.01
	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	1,536,884,025.48	2.07
8	其他各项资产	292,965,591.29	0.40
9	合计	74,114,864,299.78	100.00

注：1、上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而行业分类的合计项中不含可退替代款估值增值；

2、通过转融通证券出借业务出借的证券公允价值为 2,471,291,568.60 元，占基金资产净值的比例为 3.34%。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	465,539,046.07	0.63
B	采矿业	3,382,202,597.16	4.58
C	制造业	45,622,856,285.49	61.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,919,737,863.91	3.95
E	建筑业	741,403,661.34	1.00
F	批发和零售业	1,558,409,476.50	2.11
G	交通运输、仓储和邮政业	1,450,834,437.63	1.96
H	住宿和餐饮业	223,821,867.35	0.30
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,142,011,686.47	6.96
J	金融业	6,732,396,723.16	9.11
K	房地产业	826,508,131.63	1.12
L	租赁和商务服务业	555,946,416.70	0.75
M	科学研究和技术服务业	569,927,097.59	0.77
N	水利、环境和公共设施管理业	335,369,251.94	0.45
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	79,749,977.04	0.11
Q	卫生和社会工作	452,762,458.88	0.61
R	文化、体育和娱乐业	1,083,782,398.28	1.47
S	综合	128,382,122.88	0.17
	合计	72,271,641,500.02	97.81

7.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	471,565.43	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	46,981.02	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	2,628,515.96	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	3,147,062.41	0.00

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300502	新易盛	8,572,093	904,784,416.15	1.22
2	002028	思源电气	7,477,467	500,242,542.30	0.68
3	601058	赛轮轮胎	31,867,980	446,151,720.00	0.60
4	688169	石头科技	1,106,781	434,522,220.60	0.59
5	600066	宇通客车	16,355,383	421,968,881.40	0.57
6	002340	格林美	62,609,870	398,824,871.90	0.54
7	000933	神火股份	19,148,600	387,376,178.00	0.52
8	601077	渝农商行	75,291,100	377,961,322.00	0.51

9	601168	西部矿业	20,333,736	364,990,561.20	0.49
10	000988	华工科技	12,163,112	364,041,942.16	0.49
11	300394	天孚通信	3,979,796	351,893,562.32	0.48
12	000423	东阿阿胶	5,598,995	350,497,087.00	0.47
13	002384	东山精密	16,840,700	348,602,490.00	0.47
14	600418	江淮汽车	21,384,799	338,735,216.16	0.46
15	600988	赤峰黄金	20,407,835	333,464,023.90	0.45
16	601233	桐昆股份	20,832,840	332,492,126.40	0.45
17	000630	铜陵有色	92,068,896	332,368,714.56	0.45
18	600157	永泰能源	271,298,800	320,132,584.00	0.43
19	002625	光启技术	18,208,778	315,922,298.30	0.43
20	600096	云天化	15,331,265	297,733,166.30	0.40
21	000400	许继电气	8,623,009	296,717,739.69	0.40
22	601567	三星医疗	8,453,817	295,883,595.00	0.40
23	002156	通富微电	13,140,877	294,224,236.03	0.40
24	002273	水晶光电	17,096,343	290,295,904.14	0.39
25	002078	太阳纸业	20,669,405	288,338,199.75	0.39
26	688777	中控技术	7,602,396	286,610,329.20	0.39
27	002128	电投能源	13,578,728	286,511,160.80	0.39
28	601555	东吴证券	48,505,576	286,182,898.40	0.39
29	600885	宏发股份	10,239,496	283,429,249.28	0.38
30	601128	常熟银行	36,868,931	279,097,807.67	0.38
31	002532	天山铝业	33,709,200	273,381,612.00	0.37
32	600352	浙江龙盛	31,817,315	273,310,735.85	0.37
33	002138	顺络电子	9,931,704	272,724,591.84	0.37
34	300207	欣旺达	17,943,398	272,201,347.66	0.37
35	002223	鱼跃医疗	7,192,116	270,423,561.60	0.37
36	002966	苏州银行	35,644,430	267,333,225.00	0.36
37	600398	海澜之家	28,840,836	266,489,324.64	0.36
38	600765	中航重机	12,876,263	262,675,765.20	0.36
39	601108	财通证券	39,313,498	259,862,221.78	0.35
40	002353	杰瑞股份	7,333,049	257,243,358.92	0.35
41	002185	华天科技	31,550,166	257,133,852.90	0.35
42	002517	恺英网络	26,487,713	252,957,659.15	0.34
43	688617	惠泰医疗	552,661	252,068,682.10	0.34
44	301236	软通动力	7,039,753	247,869,703.13	0.34
45	688099	晶晨股份	4,174,646	247,640,000.72	0.34
46	600879	航天电子	31,845,537	247,439,822.49	0.33
47	600873	梅花生物	24,632,790	246,820,555.80	0.33
48	600079	人福医药	14,129,206	242,598,467.02	0.33
49	600177	雅戈尔	34,046,590	242,411,720.80	0.33
50	603606	东方电缆	4,958,551	242,026,874.31	0.33
51	600109	国金证券	31,825,300	240,281,015.00	0.33

52	002738	中矿资源	8,954,483	239,980,144.40	0.32
53	600060	海信视像	9,687,470	239,668,007.80	0.32
54	300003	乐普医疗	16,106,140	239,015,117.60	0.32
55	601577	长沙银行	28,842,998	235,935,723.64	0.32
56	603160	汇顶科技	3,391,792	233,185,700.00	0.32
57	300017	网宿科技	29,464,698	232,771,114.20	0.32
58	600497	驰宏锌锗	42,991,936	229,576,938.24	0.31
59	689009	九号公司	6,147,891	226,303,867.71	0.31
60	300136	信维通信	11,529,600	225,749,568.00	0.31
61	603979	金诚信	4,421,460	223,416,373.80	0.30
62	000932	华菱钢铁	50,089,616	221,896,998.88	0.30
63	002202	金风科技	33,010,194	221,828,503.68	0.30
64	002409	雅克科技	3,515,483	221,159,035.53	0.30
65	002739	万达电影	18,185,518	219,862,912.62	0.30
66	002465	海格通信	21,135,098	218,959,615.28	0.30
67	600985	淮北矿业	13,078,795	218,939,028.30	0.30
68	688122	西部超导	5,704,953	218,613,798.96	0.30
69	002281	光迅科技	5,843,978	218,389,457.86	0.30
70	000683	远兴能源	31,603,900	218,382,949.00	0.30
71	002008	大族激光	10,476,274	217,906,499.20	0.29
72	600536	中国软件	7,258,464	217,173,242.88	0.29
73	600348	华阳股份	21,773,123	216,860,305.08	0.29
74	002444	巨星科技	8,766,226	216,525,782.20	0.29
75	300474	景嘉微	3,399,569	214,954,747.87	0.29
76	000009	中国宝安	24,873,550	213,912,530.00	0.29
77	688120	华海清科	1,126,291	213,522,247.78	0.29
78	000878	云南铜业	17,056,565	212,524,799.90	0.29
79	002797	第一创业	41,503,389	211,252,250.01	0.29
80	601990	南京证券	27,439,447	210,734,952.96	0.29
81	600642	申能股份	23,842,183	210,526,475.89	0.28
82	000066	中国长城	23,991,186	209,922,877.50	0.28
83	002436	兴森科技	20,297,110	209,466,175.20	0.28
84	300012	华测检测	20,711,200	208,354,672.00	0.28
85	300054	鼎龙股份	9,119,050	206,820,054.00	0.28
86	688525	佰维存储	3,410,412	206,692,929.80	0.28
87	601615	明阳智能	21,816,678	205,949,440.32	0.28
88	000039	中集集团	22,170,966	205,303,145.16	0.28
89	600839	四川长虹	45,651,806	204,976,608.94	0.28
90	603596	伯特利	5,229,195	203,415,685.50	0.28
91	600298	安琪酵母	7,247,000	202,408,710.00	0.27
92	002673	西部证券	32,479,600	201,048,724.00	0.27
93	601179	中国西电	24,888,376	200,102,543.04	0.27
94	300395	菲利华	6,499,480	199,859,010.00	0.27

95	600529	山东药玻	7,880,906	199,702,158.04	0.27
96	603816	顾家家居	6,163,420	199,016,831.80	0.27
97	601666	平煤股份	17,768,920	199,011,904.00	0.27
98	601717	郑煤机	13,399,843	198,317,676.40	0.27
99	600862	中航高科	10,407,913	195,460,606.14	0.26
100	000783	长江证券	40,153,065	193,939,303.95	0.26
101	000728	国元证券	31,923,321	193,455,325.26	0.26
102	000738	航发控制	9,606,862	192,809,720.34	0.26
103	601198	东兴证券	24,143,726	192,184,058.96	0.26
104	000831	中国稀土	7,566,040	191,799,114.00	0.26
105	300002	神州泰岳	23,576,600	191,441,992.00	0.26
106	000703	恒逸石化	26,899,100	190,714,619.00	0.26
107	688180	君实生物	6,542,087	190,047,627.35	0.26
108	603338	浙江鼎力	3,142,713	189,882,719.46	0.26
109	601696	中银证券	20,787,100	188,746,868.00	0.26
110	300866	安克创新	2,650,251	188,724,373.71	0.26
111	002432	九安医疗	4,651,663	188,578,418.02	0.26
112	002155	湖南黄金	10,402,200	188,279,820.00	0.25
113	603345	安井食品	2,531,139	188,088,939.09	0.25
114	601997	贵阳银行	35,562,712	187,415,492.24	0.25
115	300037	新宙邦	6,509,982	185,925,085.92	0.25
116	601162	天风证券	84,852,453	184,978,347.54	0.25
117	300001	特锐德	9,193,121	184,965,594.52	0.25
118	600141	兴发集团	9,681,540	184,723,783.20	0.25
119	002294	信立泰	6,926,190	184,444,439.70	0.25
120	300724	捷佳伟创	3,414,204	184,401,158.04	0.25
121	002850	科达利	2,403,213	183,557,408.94	0.25
122	600863	内蒙华电	39,503,801	183,297,636.64	0.25
123	600521	华海药业	10,736,600	183,059,030.00	0.25
124	000921	海信家电	5,658,358	182,425,461.92	0.25
125	603939	益丰药房	7,425,030	182,284,486.50	0.25
126	002595	豪迈科技	4,756,153	181,542,360.01	0.25
127	000960	锡业股份	11,715,593	181,474,535.57	0.25
128	600549	厦门钨业	10,500,222	181,128,829.50	0.25
129	002984	森麒麟	7,463,180	179,788,006.20	0.24
130	300285	国瓷材料	9,977,831	178,104,283.35	0.24
131	600820	隧道股份	27,237,739	177,862,435.67	0.24
132	301358	湖南裕能	5,644,738	177,583,457.48	0.24
133	600038	中直股份	4,317,091	177,475,611.01	0.24
134	688188	柏楚电子	961,569	177,457,558.95	0.24
135	600895	张江高科	9,601,110	177,428,512.80	0.24
136	600546	山煤国际	12,129,090	177,327,295.80	0.24
137	002407	多氟多	14,476,856	177,051,948.88	0.24

138	002472	双环传动	8,021,600	176,635,632.00	0.24
139	300699	光威复材	7,084,506	175,908,283.98	0.24
140	600369	西南证券	48,852,557	174,892,154.06	0.24
141	002195	岩山科技	69,634,326	174,782,158.26	0.24
142	002064	华峰化学	24,274,476	174,047,992.92	0.24
143	600486	扬农化工	3,075,961	173,637,998.45	0.23
144	600699	均胜电子	11,699,958	173,393,377.56	0.23
145	600021	上海电力	17,454,885	172,628,812.65	0.23
146	002262	恩华药业	7,249,772	172,109,587.28	0.23
147	300146	汤臣倍健	12,669,967	171,678,052.85	0.23
148	600872	中炬高新	7,483,764	169,806,605.16	0.23
149	000021	深科技	11,186,070	169,133,378.40	0.23
150	688065	凯赛生物	3,730,893	168,841,733.27	0.23
151	601966	玲珑轮胎	9,164,700	168,355,539.00	0.23
152	601000	唐山港	35,788,226	168,204,662.20	0.23
153	300058	蓝色光标	30,850,066	167,824,359.04	0.23
154	603589	口子窖	4,281,769	167,802,527.11	0.23
155	600704	物产中大	38,473,538	166,975,154.92	0.23
156	300529	健帆生物	6,117,600	166,459,896.00	0.23
157	603087	甘李药业	3,593,528	166,452,216.96	0.23
158	300073	当升科技	4,810,049	165,032,781.19	0.22
159	000830	鲁西化工	14,218,298	164,790,073.82	0.22
160	600155	华创云信	27,873,003	164,729,447.73	0.22
161	002558	巨人网络	17,121,200	161,624,128.00	0.22
162	600583	海油工程	27,302,240	161,356,238.40	0.22
163	000513	丽珠集团	4,324,049	160,897,863.29	0.22
164	603179	新泉股份	4,096,129	160,732,101.96	0.22
165	300114	中航电测	3,540,753	160,219,073.25	0.22
166	600970	中材国际	13,283,704	160,201,470.24	0.22
167	002025	航天电器	3,434,300	159,282,834.00	0.22
168	600118	中国卫星	7,143,691	158,804,250.93	0.21
169	600153	建发股份	17,757,117	158,571,054.81	0.21
170	002756	永兴材料	4,429,582	158,490,443.96	0.21
171	000591	太阳能	33,630,200	158,398,242.00	0.21
172	002439	启明星辰	9,125,542	157,506,854.92	0.21
173	000623	吉林敖东	11,612,546	155,608,116.40	0.21
174	002385	大北农	40,361,029	155,389,961.65	0.21
175	601156	东航物流	7,630,100	155,272,535.00	0.21
176	000729	燕京啤酒	17,582,804	155,256,159.32	0.21
177	002152	广电运通	14,779,273	154,591,195.58	0.21
178	605358	立昂微	6,655,469	154,007,552.66	0.21
179	300677	英科医疗	5,740,043	153,890,552.83	0.21
180	000519	中兵红箭	10,478,276	153,716,308.92	0.21

181	600998	九州通	31,313,951	152,812,080.88	0.21
182	300144	宋城演艺	19,006,020	152,618,340.60	0.21
183	601216	君正集团	41,242,600	152,185,194.00	0.21
184	600143	金发科技	22,946,900	151,679,009.00	0.21
185	600380	健康元	13,564,814	151,518,972.38	0.21
186	600637	东方明珠	24,881,163	151,277,471.04	0.20
187	600516	方大炭素	34,888,839	150,370,896.09	0.20
188	600763	通策医疗	2,780,093	150,264,026.65	0.20
189	000723	美锦能源	31,514,800	150,010,448.00	0.20
190	600392	盛和资源	17,371,922	149,745,967.64	0.20
191	300383	光环新网	17,654,505	149,180,567.25	0.20
192	300251	光线传媒	17,734,208	149,144,689.28	0.20
193	300373	扬杰科技	3,829,659	148,973,735.10	0.20
194	600282	南钢股份	29,845,679	148,631,481.42	0.20
195	600909	华安证券	34,890,513	146,889,059.73	0.20
196	000883	湖北能源	24,278,894	145,916,152.94	0.20
197	002044	美年健康	38,216,463	144,458,230.14	0.20
198	601016	节能风电	48,291,995	144,393,065.05	0.20
199	000818	航锦科技	6,520,050	143,962,704.00	0.19
200	002958	青农商行	53,520,700	143,435,476.00	0.19
201	300024	机器人	14,711,706	143,292,016.44	0.19
202	600008	首创环保	53,454,113	143,257,022.84	0.19
203	300088	长信科技	30,426,938	143,006,608.60	0.19
204	600867	通化东宝	17,081,355	142,970,941.35	0.19
205	000636	风华高科	10,924,832	142,678,305.92	0.19
206	000997	新大陆	10,200,644	141,890,958.04	0.19
207	000629	钒钛股份	56,576,637	141,441,592.50	0.19
208	600582	天地科技	20,492,997	141,196,749.33	0.19
209	601665	齐鲁银行	28,715,100	140,991,141.00	0.19
210	600170	上海建工	64,591,746	138,872,253.90	0.19
211	601991	大唐发电	46,046,869	138,601,075.69	0.19
212	603000	人民网	6,914,772	138,226,292.28	0.19
213	600498	烽火通信	8,687,506	138,131,345.40	0.19
214	600499	科达制造	16,382,371	138,103,387.53	0.19
215	600511	国药股份	4,482,730	138,023,256.70	0.19
216	600566	济川药业	4,346,247	137,819,492.37	0.19
217	002430	杭氧股份	6,183,882	137,591,374.50	0.19
218	601456	国联证券	14,263,666	137,501,740.24	0.19
219	002939	长城证券	20,400,070	136,680,469.00	0.18
220	603156	养元饮品	6,419,932	136,551,953.64	0.18
221	600535	天士力	10,849,232	136,483,338.56	0.18
222	000598	兴蓉环境	18,082,959	135,983,851.68	0.18
223	300567	精测电子	2,403,282	135,809,465.82	0.18

224	601933	永辉超市	54,656,707	135,548,633.36	0.18
225	002429	兆驰股份	28,161,220	135,455,468.20	0.18
226	000750	国海证券	46,532,266	135,408,894.06	0.18
227	603658	安图生物	2,934,902	135,210,935.14	0.18
228	000060	中金岭南	31,820,917	134,920,688.08	0.18
229	002120	韵达股份	17,403,506	134,703,136.44	0.18
230	600129	太极集团	4,652,208	134,541,855.36	0.18
231	600004	白云机场	14,191,920	134,539,401.60	0.18
232	600325	华发股份	20,692,106	134,498,689.00	0.18
233	688213	思特威	2,767,827	134,239,609.50	0.18
234	600166	福田汽车	59,412,436	133,677,981.00	0.18
235	002261	拓维信息	12,062,074	133,527,159.18	0.18
236	300487	蓝晓科技	3,192,384	133,313,955.84	0.18
237	603568	伟明环保	6,470,270	133,158,156.60	0.18
238	600580	卧龙电驱	10,935,716	132,868,949.40	0.18
239	603486	科沃斯	2,813,100	132,722,058.00	0.18
240	002508	老板电器	5,998,400	132,564,640.00	0.18
241	300568	星源材质	16,119,848	132,182,753.60	0.18
242	000998	隆平高科	13,356,549	131,294,876.67	0.18
243	300118	东方日升	10,845,951	131,236,007.10	0.18
244	600737	中粮糖业	13,580,074	130,232,909.66	0.18
245	002624	完美世界	17,135,197	130,227,497.20	0.18
246	600816	建元信托	47,689,040	129,237,298.40	0.17
247	000027	深圳能源	17,701,389	129,220,139.70	0.17
248	600563	法拉电子	1,687,421	128,547,731.78	0.17
249	600673	东阳光	18,236,097	128,382,122.88	0.17
250	600754	锦江酒店	5,581,000	128,251,380.00	0.17
251	601636	旗滨集团	19,881,933	128,238,467.85	0.17
252	002299	圣农发展	9,380,897	127,955,435.08	0.17
253	603927	中科软	7,068,834	127,875,207.06	0.17
254	603228	景旺电子	4,000,987	127,231,386.60	0.17
255	688002	睿创微纳	4,535,308	126,852,564.76	0.17
256	002497	雅化集团	14,210,257	126,755,492.44	0.17
257	002056	横店东磁	10,153,494	126,614,070.18	0.17
258	002065	东华软件	27,977,018	126,456,121.36	0.17
259	688385	复旦微电	4,018,561	126,102,444.18	0.17
260	601866	中远海发	48,691,847	125,624,965.26	0.17
261	600655	豫园股份	24,288,242	125,084,446.30	0.17
262	002500	山西证券	26,574,777	124,901,451.90	0.17
263	002926	华西证券	18,944,176	124,842,119.84	0.17
264	300253	卫宁健康	21,131,862	124,677,985.80	0.17
265	603893	瑞芯微	2,105,463	124,580,245.71	0.17
266	000893	亚钾国际	7,702,071	124,465,467.36	0.17

267	601231	环旭电子	7,742,400	124,265,520.00	0.17
268	002507	涪陵榨菜	10,123,753	124,015,974.25	0.17
269	300765	新诺威	4,912,276	123,936,723.48	0.17
270	002368	太极股份	5,491,675	123,837,271.25	0.17
271	300601	康泰生物	7,926,520	123,732,977.20	0.17
272	603077	和邦生物	74,949,203	123,666,184.95	0.17
273	300390	天华新能	7,170,370	123,186,956.60	0.17
274	300604	长川科技	4,506,548	122,442,909.16	0.17
275	603298	杭叉集团	6,228,320	122,324,204.80	0.17
276	002414	高德红外	20,711,320	121,989,674.80	0.17
277	300763	锦浪科技	2,922,673	121,700,103.72	0.16
278	300009	安科生物	14,230,428	121,527,855.12	0.16
279	600131	国网信通	7,202,973	121,514,154.51	0.16
280	600707	彩虹股份	17,841,407	121,499,981.67	0.16
281	603379	三美股份	3,080,038	120,552,687.32	0.16
282	002653	海思科	3,923,710	120,457,897.00	0.16
283	000887	中鼎股份	9,809,529	120,068,634.96	0.16
284	688521	芯原股份	4,476,565	119,748,113.75	0.16
285	600373	中文传媒	8,024,270	119,080,166.80	0.16
286	603290	斯达半导	1,380,180	118,847,299.80	0.16
287	002372	伟星新材	7,698,931	118,717,516.02	0.16
288	600755	厦门国贸	16,523,715	118,475,036.55	0.16
289	688052	纳芯微	1,150,834	118,282,718.52	0.16
290	601958	金钼股份	11,333,779	117,984,639.39	0.16
291	603885	吉祥航空	10,711,201	117,716,098.99	0.16
292	688772	珠海冠宇	7,893,007	117,605,804.30	0.16
293	601611	中国核建	14,415,955	116,625,075.95	0.16
294	600859	王府井	9,928,869	116,564,922.06	0.16
295	002019	亿帆医药	9,406,632	116,265,971.52	0.16
296	002203	海亮股份	14,460,680	115,396,226.40	0.16
297	603225	新风鸣	7,400,753	115,377,739.27	0.16
298	600329	达仁堂	3,559,756	115,300,496.84	0.16
299	002683	广东宏大	5,712,064	114,983,848.32	0.16
300	688114	华大智造	2,422,262	114,839,441.42	0.16
301	601880	辽港股份	91,737,173	112,836,722.79	0.15
302	600390	五矿资本	27,852,700	112,803,435.00	0.15
303	300070	碧水源	26,904,307	112,729,046.33	0.15
304	600435	北方导航	13,074,675	112,703,698.50	0.15
305	600739	辽宁成大	13,463,334	112,688,105.58	0.15
306	600884	杉杉股份	13,869,373	112,619,308.76	0.15
307	600399	抚顺特钢	19,880,950	111,929,748.50	0.15
308	002506	协鑫集成	57,395,878	111,348,003.32	0.15
309	002568	百润股份	6,606,524	111,187,798.92	0.15

310	688390	固德威	1,977,002	110,949,352.24	0.15
311	300296	利亚德	24,638,068	110,871,306.00	0.15
312	300676	华大基因	3,156,800	110,519,568.00	0.15
313	601098	中南传媒	8,895,564	110,482,904.88	0.15
314	002831	裕同科技	4,311,376	110,328,111.84	0.15
315	600995	南网储能	11,388,147	110,009,500.02	0.15
316	601598	中国外运	19,404,672	109,248,303.36	0.15
317	600598	北大荒	8,742,043	109,188,117.07	0.15
318	001286	陕西能源	9,467,568	109,161,059.04	0.15
319	002244	滨江集团	14,992,895	108,848,417.70	0.15
320	600416	湘电股份	10,937,702	108,720,757.88	0.15
321	002572	索菲亚	7,044,258	107,988,475.14	0.15
322	600801	华新水泥	7,800,024	107,250,330.00	0.15
323	300595	欧普康视	6,824,223	107,003,816.64	0.14
324	002373	千方科技	11,788,816	106,924,561.12	0.14
325	600483	福能股份	9,159,217	106,796,470.22	0.14
326	300803	指南针	2,931,476	106,735,041.16	0.14
327	600901	江苏金租	21,060,094	106,353,474.70	0.14
328	603712	七一二	5,818,619	105,840,679.61	0.14
329	000050	深天马 A	14,503,485	105,585,370.80	0.14
330	601928	凤凰传媒	9,619,548	105,430,246.08	0.14
331	002080	中材科技	8,140,431	105,011,559.90	0.14
332	600968	海油发展	25,412,160	104,698,099.20	0.14
333	600848	上海临港	11,471,181	104,502,458.91	0.14
334	000155	川能动力	9,698,877	104,456,905.29	0.14
335	603858	步长制药	6,874,566	104,149,674.90	0.14
336	002936	郑州银行	60,048,512	103,883,925.76	0.14
337	000563	陕国投 A	37,712,686	103,709,886.50	0.14
338	300748	金力永磁	7,929,677	102,768,613.92	0.14
339	300558	贝达药业	3,156,004	102,727,930.20	0.14
340	002268	电科网安	7,208,156	102,572,059.88	0.14
341	600271	航天信息	13,920,502	102,454,894.72	0.14
342	002487	大金重工	4,460,002	102,044,845.76	0.14
343	600977	中国电影	9,451,650	101,699,754.00	0.14
344	002557	洽洽食品	3,606,504	101,667,347.76	0.14
345	600528	中铁工业	13,881,688	101,613,956.16	0.14
346	688005	容百科技	4,353,498	101,349,433.44	0.14
347	603883	老百姓	5,512,150	101,203,074.00	0.14
348	002240	盛新锂能	7,528,504	101,032,523.68	0.14
349	000778	新兴铸管	28,928,301	100,670,487.48	0.14
350	601212	白银有色	35,933,400	99,894,852.00	0.14
351	688538	和辉光电	50,330,872	99,655,126.56	0.13
352	002408	齐翔腾达	17,790,125	99,624,700.00	0.13

353	603737	三棵树	2,739,014	99,344,037.78	0.13
354	600378	昊华科技	3,434,518	99,257,570.20	0.13
355	000739	普洛药业	7,189,060	97,555,544.20	0.13
356	600062	华润双鹤	4,979,060	97,489,994.80	0.13
357	601118	海南橡胶	21,340,795	97,100,617.25	0.13
358	000709	河钢股份	49,919,500	96,843,830.00	0.13
359	002531	天顺风能	10,817,897	96,711,999.18	0.13
360	688017	绿的谐波	1,171,825	96,206,832.50	0.13
361	600056	中国医药	9,501,360	96,153,763.20	0.13
362	600612	老凤祥	1,650,440	96,039,103.60	0.13
363	000825	太钢不锈	28,356,148	95,843,780.24	0.13
364	601155	新城控股	10,775,140	95,575,491.80	0.13
365	600258	首旅酒店	7,738,501	95,570,487.35	0.13
366	600959	江苏有线	36,194,069	95,552,342.16	0.13
367	688301	奕瑞科技	826,518	95,239,669.14	0.13
368	603688	石英股份	3,212,366	95,118,157.26	0.13
369	603882	金域医学	3,488,447	94,850,873.93	0.13
370	600316	洪都航空	5,609,810	93,291,140.30	0.13
371	600517	国网英大	21,378,167	92,567,463.11	0.13
372	600906	财达证券	16,113,832	92,332,257.36	0.12
373	603456	九洲药业	6,713,342	92,107,052.24	0.12
374	300212	易华录	5,468,891	92,041,435.53	0.12
375	688234	天岳先进	1,960,336	91,978,965.12	0.12
376	688567	孚能科技	9,417,969	90,412,502.40	0.12
377	688220	翱捷科技	2,395,021	89,717,486.66	0.12
378	603529	爱玛科技	3,282,655	89,714,961.15	0.12
379	002266	浙富控股	32,072,419	89,482,049.01	0.12
380	601019	山东出版	7,563,711	89,403,064.02	0.12
381	000987	越秀资本	17,995,217	89,256,276.32	0.12
382	000937	冀中能源	13,301,284	89,118,602.80	0.12
383	688536	思瑞浦	907,769	88,788,885.89	0.12
384	603444	吉比特	495,731	88,245,075.31	0.12
385	600871	石化油服	50,247,500	87,430,650.00	0.12
386	688331	荣昌生物	2,019,877	87,258,686.40	0.12
387	603728	鸣志电器	2,158,755	86,846,713.65	0.12
388	601399	国机重装	33,180,080	85,604,606.40	0.12
389	688200	华峰测控	920,458	84,452,021.50	0.11
390	001227	兰州银行	35,455,500	84,384,090.00	0.11
391	688561	奇安信	3,569,587	84,313,644.94	0.11
392	600925	苏能股份	16,677,800	84,222,890.00	0.11
393	603650	彤程新材	2,849,582	84,205,148.10	0.11
394	600208	新潮中宝	52,860,149	83,519,035.42	0.11
395	600663	陆家嘴	9,468,796	83,514,780.72	0.11

396	603233	大参林	5,759,027	82,354,086.10	0.11
397	000032	深桑达 A	5,474,675	82,010,631.50	0.11
398	601608	中信重工	21,499,032	81,911,311.92	0.11
399	600022	山东钢铁	67,070,215	81,825,662.30	0.11
400	003031	中瓷电子	1,767,256	81,717,917.44	0.11
401	002423	中粮资本	10,903,874	81,670,016.26	0.11
402	002670	国盛金控	9,532,711	80,742,062.17	0.11
403	601298	青岛港	8,410,229	80,401,789.24	0.11
404	300776	帝尔激光	1,742,481	80,084,426.76	0.11
405	601106	中国一重	34,558,700	79,830,597.00	0.11
406	002607	中公教育	52,124,168	79,749,977.04	0.11
407	600098	广州发展	12,431,002	79,558,412.80	0.11
408	002865	钧达股份	2,070,441	79,463,525.58	0.11
409	600377	宁沪高速	6,243,083	78,662,845.80	0.11
410	688063	派能科技	1,957,578	77,735,422.38	0.11
411	601965	中国汽研	4,583,841	77,421,074.49	0.10
412	688297	中无人机	2,324,697	76,784,741.91	0.10
413	600578	京能电力	23,581,900	76,405,356.00	0.10
414	300888	稳健医疗	3,017,860	76,351,858.00	0.10
415	000785	居然之家	31,134,300	75,656,349.00	0.10
416	600967	内蒙一机	10,505,734	75,641,284.80	0.10
417	600827	百联股份	10,218,430	75,412,013.40	0.10
418	300357	我武生物	3,719,978	75,217,955.16	0.10
419	300438	鹏辉能源	4,101,000	75,212,340.00	0.10
420	603826	坤彩科技	2,595,928	75,204,034.16	0.10
421	000958	电投产融	20,523,000	75,114,180.00	0.10
422	688516	奥特维	1,793,421	74,982,932.01	0.10
423	000559	万向钱潮	16,808,248	74,964,786.08	0.10
424	002608	江苏国信	9,668,235	74,928,821.25	0.10
425	603707	健友股份	6,211,815	73,796,362.20	0.10
426	688425	铁建重工	20,008,735	73,632,144.80	0.10
427	002867	周大生	5,612,975	73,305,453.50	0.10
428	600500	中化国际	20,717,918	72,305,533.82	0.10
429	600350	山东高速	8,035,928	71,117,962.80	0.10
430	600126	杭钢股份	17,223,230	70,787,475.30	0.10
431	601992	金隅集团	51,284,689	70,260,023.93	0.10
432	000537	中绿电	7,251,605	69,107,795.65	0.09
433	000156	华数传媒	10,982,518	68,970,213.04	0.09
434	600315	上海家化	3,829,171	68,082,660.38	0.09
435	601568	北元集团	18,274,057	67,796,751.47	0.09
436	688349	三一重能	2,721,880	67,611,499.20	0.09
437	002690	美亚光电	4,077,735	67,282,627.50	0.09
438	603517	绝味食品	4,291,604	66,090,701.60	0.09

439	600339	中油工程	21,099,934	65,831,794.08	0.09
440	600481	双良节能	13,974,962	65,263,072.54	0.09
441	688029	南微医学	1,056,357	65,029,336.92	0.09
442	603218	日月股份	6,315,839	64,863,666.53	0.09
443	600032	浙江新能	8,878,371	64,634,540.88	0.09
444	300682	朗新集团	7,508,200	63,894,782.00	0.09
445	688032	禾迈股份	555,347	63,742,728.66	0.09
446	301267	华夏眼科	3,049,678	63,189,328.16	0.09
447	000967	盈峰环境	14,874,514	62,919,194.22	0.09
448	600095	湘财股份	10,541,700	62,828,532.00	0.09
449	003022	联泓新科	4,577,264	62,754,289.44	0.08
450	000898	鞍钢股份	28,969,848	61,416,077.76	0.08
451	600361	创新新材	15,188,800	61,210,864.00	0.08
452	003035	南网能源	13,840,990	60,900,356.00	0.08
453	002563	森马服饰	10,297,075	59,826,005.75	0.08
454	002153	石基信息	10,376,601	59,457,923.73	0.08
455	600808	马钢股份	29,252,996	59,091,051.92	0.08
456	688475	萤石网络	1,731,609	59,065,182.99	0.08
457	001872	招商港口	3,051,733	58,745,860.25	0.08
458	603185	弘元绿能	3,416,112	58,381,354.08	0.08
459	688520	神州细胞	1,481,623	58,301,865.05	0.08
460	688778	厦钨新能	1,859,419	58,088,249.56	0.08
461	603786	科博达	898,548	57,641,854.20	0.08
462	603127	昭衍新药	4,336,919	57,550,915.13	0.08
463	001203	大中矿业	5,959,909	57,274,725.49	0.08
464	600928	西安银行	17,175,000	56,162,250.00	0.08
465	000401	冀东水泥	13,634,582	55,356,402.92	0.07
466	601228	广州港	18,111,860	55,241,173.00	0.07
467	688248	南网科技	1,862,319	55,180,511.97	0.07
468	000539	粤电力 A	10,821,600	54,973,728.00	0.07
469	002518	科士达	3,067,000	54,285,900.00	0.07
470	688281	华秦科技	649,591	54,123,922.12	0.07
471	688779	五矿新能	11,389,183	52,731,917.29	0.07
472	600764	中国海防	2,668,424	52,381,163.12	0.07
473	000959	首钢股份	18,497,152	50,312,253.44	0.07
474	300861	美畅股份	2,559,721	49,530,601.35	0.07
475	603056	德邦股份	3,703,739	48,518,980.90	0.07
476	601139	深圳燃气	7,047,457	47,077,012.76	0.06
477	688006	杭可科技	2,637,901	46,031,372.45	0.06
478	301029	怡合达	2,322,340	45,657,204.40	0.06
479	002791	坚朗五金	1,760,600	45,546,722.00	0.06
480	603305	旭升集团	4,245,584	44,833,367.04	0.06
481	600299	安迪苏	4,557,300	44,205,810.00	0.06

482	603317	天味食品	3,716,003	42,399,594.23	0.06
483	688172	燕东微	2,597,316	42,024,572.88	0.06
484	600927	永安期货	3,596,467	40,100,607.05	0.05
485	000031	大悦城	16,504,592	38,620,745.28	0.05
486	688387	信科移动	7,588,249	38,244,774.96	0.05
487	688276	百克生物	1,347,094	38,217,056.78	0.05
488	688375	国博电子	527,440	37,258,361.60	0.05
489	688107	安路科技	1,428,216	36,305,250.72	0.05
490	601858	中国科传	1,886,000	36,060,320.00	0.05
491	601828	美凯龙	13,890,046	35,419,617.30	0.05
492	002945	华林证券	3,510,630	35,036,087.40	0.05
493	688819	天能股份	1,462,528	34,895,918.08	0.05
494	601158	重庆水务	7,245,300	34,777,440.00	0.05
495	688153	唯捷创芯	863,099	31,934,663.00	0.04
496	600956	新天绿能	3,718,676	30,381,582.92	0.04
497	688348	昱能科技	483,952	28,553,168.00	0.04
498	688295	中复神鹰	1,106,541	22,462,782.30	0.03
499	301165	锐捷网络	749,000	22,350,160.00	0.03
500	603868	飞科电器	483,997	18,585,484.80	0.03

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	400174	中天 3	18,775,114	2,628,515.96	0.00
2	301589	诺瓦星云	1,244	233,884.44	0.00
3	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
4	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
5	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
6	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
7	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
8	688584	上海合晶	866	13,760.74	0.00
9	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
10	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
11	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
12	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
13	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
14	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
15	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
16	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
17	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
18	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00

19	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
20	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
21	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
22	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
23	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
24	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
25	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
26	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
27	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
28	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
29	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
30	603375	盛景微	72	2,800.80	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	300502	新易盛	708,149,621.48	1.51
2	002028	思源电气	463,544,965.54	0.99
3	000423	东阿阿胶	453,169,461.29	0.97
4	300394	天孚通信	452,020,919.16	0.97
5	002463	沪电股份	435,545,346.85	0.93
6	000988	华工科技	427,068,108.92	0.91
7	000933	神火股份	416,025,202.62	0.89
8	002422	科伦药业	402,974,209.68	0.86
9	000975	山金国际	369,810,975.96	0.79
10	002340	格林美	364,036,141.79	0.78
11	300418	昆仑万维	354,312,928.67	0.76
12	002850	科达利	348,824,188.05	0.75
13	002966	苏州银行	344,538,905.55	0.74
14	000630	铜陵有色	334,926,354.49	0.72
15	002156	通富微电	321,569,306.38	0.69
16	002517	恺英网络	314,527,000.74	0.67
17	002078	太阳纸业	309,680,244.93	0.66
18	688777	中控技术	303,074,724.37	0.65
19	002738	中矿资源	298,922,929.90	0.64
20	300866	安克创新	295,352,484.31	0.63

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002463	沪电股份	840,959,500.40	1.80
2	002422	科伦药业	726,562,302.63	1.55
3	000975	山金国际	654,937,908.91	1.40
4	300418	昆仑万维	581,158,515.44	1.24
5	300502	新易盛	512,251,518.93	1.10
6	600160	巨化股份	367,278,953.94	0.79
7	300394	天孚通信	360,339,348.55	0.77
8	000423	东阿阿胶	321,279,557.39	0.69
9	600161	天坛生物	305,942,514.03	0.65
10	000988	华工科技	300,170,761.96	0.64
11	000933	神火股份	287,131,276.61	0.61
12	002028	思源电气	285,432,587.88	0.61
13	002966	苏州银行	277,121,189.09	0.59
14	002600	领益智造	273,170,361.60	0.58
15	600415	小商品城	271,465,602.22	0.58
16	300866	安克创新	262,966,642.01	0.56
17	002032	苏泊尔	250,872,361.46	0.54
18	002340	格林美	249,520,951.48	0.53
19	600482	中国动力	246,621,219.04	0.53
20	002850	科达利	244,687,777.71	0.52

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	50,525,063,693.37
卖出股票收入（成交）总额	35,259,128,275.43

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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（元）	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
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）	10,163,757.35	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,163,757.35	0.01

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113685	升 24 转债	101,630	10,163,757.35	0.01

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

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明

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

7.12.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。如是，还应对相关股票的投资决策程序做出说明

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，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

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（元）
1	存出保证金	218,278,499.09
2	应收清算款	69,658,126.10
3	应收股利	4,018,970.51
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	1,009,995.59
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	292,965,591.29

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	300502	新易盛	32,382,740.00	0.04	转融通融出
2	002028	思源电气	17,768,640.00	0.02	转融通融出
3	601058	赛轮轮胎	14,901,600.00	0.02	转融通融出

			0		
4	688169	石头科技	14,722,500.00	0.02	转融通融出
5	002340	格林美	14,110,824.00	0.02	转融通融出
6	600066	宇通客车	13,846,860.00	0.02	转融通融出
7	000933	神火股份	13,750,331.00	0.02	转融通融出
8	000988	华工科技	12,977,648.00	0.02	转融通融出
9	601077	渝农商行	12,575,100.00	0.02	转融通融出
10	601168	西部矿业	12,110,865.00	0.02	转融通融出

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	400174	中天 3	2,628,515.96	0.00	暂停转让
2	301589	诺瓦星云	233,884.44	0.00	新股锁定期
3	688692	达梦数据	30,612.75	0.00	新股锁定期
4	603285	键邦股份	24,002.55	0.00	新股未上市
5	603350	安乃达	21,608.56	0.00	新股未上市

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
235,567	62,715.78	11,196,365,592.00	75.79%	2,105,560,949.00	14.25%	1,471,842,076.00	9.96%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中央汇金投资有限责任公司	8,235,101,633.00	55.74%
2	中国人寿保险股份有限公司	800,552,349.00	5.42%
3	幸福人寿保险股份有限公司—传统险	112,984,800.00	0.76%

4	易方达基金—中央汇金资产管理有限责任公司—易方达基金—汇金资管单一资产管理计划	110,000,004.00	0.74%
5	大家人寿保险股份有限公司—万能产品	97,653,162.00	0.66%
6	中央汇金资产管理有限责任公司	89,439,620.00	0.61%
7	上海证券有限责任公司融券专用证券账户	63,790,097.00	0.43%
8	华泰证券股份有限公司	59,367,074.00	0.40%
9	东吴证券股份有限公司	52,119,263.00	0.35%
10	申万宏源证券有限公司融券专用证券账户	48,865,800.00	0.33%
11	中国农业银行—南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)	1,471,842,076.00	9.96%

注：持有人名称与注册登记机构持有人名册保持一致。其中：“中国农业银行股份有限公司—南方中证 500 指数证券投资基金 (LOF)” 对应的基金全称为“中国农业银行股份有限公司—南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)”。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本公司的所有从业人员 (包含高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理) 均未持有本基金份额。

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

本公司的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理均未持有本基金份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2013 年 2 月 6 日)基金份额总额	1,147,553,216.00
本报告期期初基金份额总额	8,462,568,617.00
本报告期基金总申购份额	15,072,400,000.00
减：报告期基金总赎回份额	8,761,200,000.00
本报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	14,773,768,617.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金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，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

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

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

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	
华泰证券	5	74,009,409,771.71	86.28%	7,401,850.47	86.28%	-
申万宏源	2	5,808,043,618.80	6.77%	580,819.14	6.77%	-
银河证券	2	3,108,646,896.81	3.62%	310,879.46	3.62%	-

平安证券	2	2,770,255,416.01	3.23%	277,035.22	3.23%	-
东北证券	2	86,059,787.10	0.10%	8,606.09	0.10%	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

注：交易单元的选择标准和程序根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48 号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

A：选择标准

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- 4、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

B：选择流程 公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择席位：

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；
- 3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

C：报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

新增交易单元：

无

减少交易单元：

英大证券

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰证券	1,051,393.20	7.70%	-	-	-	-
申万宏源	6,657,482.26	48.75%	-	-	-	-

银河证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	5,948,165.10	43.55%	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

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	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加中原证券为一级交易商的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-18
2	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加山西证券为一级交易商的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-02-01
3	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-02-02
4	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-02-24
5	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加渤海证券为一级交易商的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-03-15
6	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-03-29
7	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加民生证券为一级交易商的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-04-24
8	中证 500 交易型开放式指数证券投资基金分红公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-05-10
9	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-05-30
10	南方基金管理股份有限公司关于终止北京中期时代基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-06-20

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20240101-20240630	1,979,722,756.00	6,255,378,877.00	-	8,235,101,633.00	55.74%

产品特有风险

本基金存在持有基金份额超过 20%的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。

注：申购份额包含红利再投资和份额折算。

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、中国证监会批准设立中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；
- 6、《中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年中期报告》原文。

12.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>