

天弘中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人:天弘基金管理有限公司

基金托管人:国泰君安证券股份有限公司

送出日期:2022 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年08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2022年01月01日起至2022年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	131
7.1 期末基金资产组合情况	131
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	131
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	133
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	151
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	153
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	154
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	154
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	154
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	154
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	154
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	155
7.12 投资组合报告附注	155
§8 基金份额持有人信息	157
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	157
8.2 期末上市基金前十名持有人	157

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	158
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.....	158
§9 开放式基金份额变动.....	158
§10 重大事件揭示.....	159
10.1 基金份额持有人大会决议.....	159
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.....	159
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	159
10.4 基金投资策略的改变.....	159
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	159
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.....	159
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	159
10.8 其他重大事件.....	162
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	163
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.....	163
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	164
§12 备查文件目录.....	164
12.1 备查文件目录.....	164
12.2 存放地点.....	165
12.3 查阅方式.....	165

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	中证500ETF天弘
场内简称	中证500ETF天弘
基金主代码	159820
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020年08月07日
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,381,408,470.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2020年08月24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的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在0.2%以内，年化跟踪误差控制在2%以内。
投资策略	本基金主要采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况（如流动性不足、成份股长期停牌、法律法规限制等）导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。为使得基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数，基金可投资于经中国证监会允许的各种金融衍生产品，如股指期货以及其他与标的指数或标的指数成份

	股相关的衍生工具。本基金产品投资策略仍包括债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略、存托凭证投资策略等。
业绩比较基准	中证500指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型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	天弘基金管理有限公司	国泰君安证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林
	联系电话	022-83310208
	电子邮箱	service@thfund.com.cn
客户服务电话	95046	021-38917599-5
传真	022-83865569	021-38677819
注册地址	天津自贸试验区（中心商务区）新华路3678号宝风大厦23层	中国（上海）自由贸易试验区商城路618号
办公地址	天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层	上海市静安区新闸路669号博华广场19楼
邮政编码	300203	200041
法定代表人	韩歆毅	贺青

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.thfund.com.cn

基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公地址
------------	------------------

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 (2022年01月01日- 2022年06月30日)
本期已实现收益	-29,926,833.00
本期利润	-241,474,823.88
加权平均基金份额本期利润	-0.1074
本期加权平均净值利润率	-10.76%
本期基金份额净值增长率	-11.02%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2022年06月30日)
期末可供分配利润	65,393,278.01
期末可供分配基金份额利润	0.0275
期末基金资产净值	2,446,801,748.01
期末基金份额净值	1.0275
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022年06月30日)
基金份额累计净值增长率	2.75%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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、期末可供分配利润为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	8.10%	1.10%	7.10%	1.10%	1.00%	0.00%
过去三个月	3.43%	1.74%	2.04%	1.75%	1.39%	-0.01%
过去六个月	-11.02%	1.62%	-12.30%	1.63%	1.28%	-0.01%
过去一年	-2.96%	1.32%	-5.20%	1.33%	2.24%	-0.01%
自基金合同生效日起至 今	2.75%	1.19%	-4.67%	1.21%	7.42%	-0.02%

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

天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：1、本基金合同于2020年08月07日生效。

2、本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

§ 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

天弘基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本基金管理人”）经中国证监会证监基金字[2004]164号文批准，于2004年11月8日正式成立，注册资本金为5.143亿元人民币，总部设在天津，在北京、上海、广州、深圳、四川、浙江设有分公司。公司股权结构为：

股东名称	股权比例
蚂蚁科技集团股份有限公司	51%
天津信托有限责任公司	16.8%
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	15.6%
芜湖高新投资有限公司	5.6%
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业（有限合伙）	3.5%
新疆天惠新盟股权投资合伙企业（有限合伙）	2%
新疆天阜恒基股权投资合伙企业（有限合伙）	2%
新疆天聚宸兴股权投资合伙企业（有限合伙）	3.5%
合计	100%

截至2022年6月30日，公司共管理运作160只公募基金，公司业务范围涵盖二级市场股票投资、债券投资、现金管理、衍生品投资等。公司始终秉承“稳健理财，值得信赖”的理念，坚持为投资者带来优质的基金产品和理财服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈瑶	本基金基金经理	2020年08	-	11年	女，金融学硕士。2011年7月加盟本公司，历任交易

		月			员、交易主管，从事交易管理、程序化交易策略、基差交易策略、融资融券交易策略等研究工作。
--	--	---	--	--	---

注：1、上述任职日期/离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金按照国家法律法规及基金合同的相关约定进行操作，不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其配套规则和其他相关法律法规、基金合同的有关规定，勤勉尽责地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，本基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公平交易的执行情况包括：建立统一的研究平台和公共信息平台，保证各组合得到公平的投资资讯；公平对待不同投资组合，禁止各投资组合之间进行以利益输送为目的的投资交易活动；在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，严格执行授权审批程序；实行集中交易制度和公平交易分配制度；建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度，保证不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息的相互隔离；加强对投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系等。

报告期内，公司公平交易程序运作良好，未出现异常情况；场外、网下业务公平交易制度执行情况良好，未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析，对各投资组合不同时间窗口（1日、3日、5日）内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验，未发现违反公平交易原则的异常交易。

本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为，公平交易制度的整体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为1次，投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

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

报告期内本基金秉承合规第一、风控第一的原则，在运作过程中严格遵守基金合同，对指数基金采取被动复制的方式跟踪指数，完全复制标的指数，保证基金净值增长率与基准指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

出于基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的需要，基于谨慎原则，报告期内本基金运用股指期货工具对基金投资组合进行管理。根据风险管理的原则，本基金在报告期内运用股指期货工具旨在提高投资效率，控制基金投资组合风险水平，力求更好地实现本基金的投资目标。

报告期内，本基金跟踪误差的来源主要是申购赎回、打新、成分股调整导致的权重偏离因素。当由于申赎等情况可能对指数跟踪效果带来影响时，本基金坚持既定的指数化投资策略，对指数基金采取被动复制与组合优化相结合的方式跟踪指数，同时紧密跟踪成分股的股息事件，及时有效处理，避免权重偏离造成跟踪误差的扩大。

报告期内，本基金整体运行平稳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2022年06月30日，本基金份额净值为1.0275元，本报告期份额净值增长率-11.02%，同期业绩比较基准增长率-12.30%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年股票市场受到内外多方面因素的影响，包括俄乌冲突、美联储加息、疫情、国内经济增长压力等，整体波动和回撤幅度较大。当前，股票市场更多的关注国内宏观经济修复情况。

宏观经济方面，国内经历了3-5月的疫情影响，随着疫情得到逐步控制，复工的环比修复也已基本结束，但经济景气度偏弱，疫情仍存在散点反复，固定资产投资和出口景气度的恢复相对较慢，房地产销售仍有压力，消费需求仍较疲软。

政策方面，值得注意的是，三季度开始，CPI的上行可能对货币政策形成一定制约。6月社融放量超预期，信贷冲量上行，结构改善，但一定程度上与6月份地产积压的购房需求释放，以及政府债券集中发行激发基建融资需求等因素有关。信贷结构是否持续改善仍需要观察。社融方面，今年的专项债额度已经基本发行完，下半年政府债券对社融的支撑减弱，还需要关注是否有增量的财政政策工具。

整体上，我们认为下半年政策大概率仍将继续维持稳增长的方向，同时不排除新的稳增长政策加码的可能，我们相信，随着政策的实施和见效，经济将继续走出逐步修复的态势。

对股票市场而言，我们认为，下半年稳增长板块仍有一定看点。股票市场在见到政策的持续效果之前，可能波动会加大，但随着稳增长的效果呈现，股票市场仍有一定的行情演绎。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策，对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督，对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更和执行。确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益。估值委员会成员由公司分管投资的高级管理人员、督察长、首席风控官、分管估值业务高级管理人员以及研究管理人员组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理（投资经理）、股票/债券研究员、基金运营部、风险管理部和内控合规部的相关人员组成。

基金经理作为估值工作小组的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定。但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签订与估值相关的定价服务协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，国泰君安证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况（如有）、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	25,995,130.97	45,464,854.58
结算备付金		64,873,396.41	116,832,783.44
存出保证金		13,947,427.16	25,430,838.76
交易性金融资产	6.4.7.2	2,343,876,189.99	2,190,227,299.39
其中：股票投资		2,343,729,662.38	2,190,025,003.29
基金投资		-	-
债券投资		146,527.61	202,296.10
资产支持证券投资		-	-

贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
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		18,362.34	260,190.17
应收股利		398,127.82	539.00
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	130,104.64	284,867.79
资产总计		2,449,238,739.33	2,378,501,373.13
负债和净资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		443,160.32	1,304,905.52
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		977,321.95	1,015,836.23
应付托管费		195,464.38	203,167.27
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3,046.53	189,223.40

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	817,998.14	1,121,223.54
负债合计		2,436,991.32	3,834,355.96
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	2,381,408,470.00	2,056,408,470.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	65,393,278.01	318,258,547.17
净资产合计		2,446,801,748.01	2,374,667,017.17
负债和净资产总计		2,449,238,739.33	2,378,501,373.13

注：报告截止日2022年06月30日，基金份额净值1.0275元，基金份额总额2,381,408,470.00份。

6.2 利润表

会计主体：天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年01月01日至 2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至202 1年06月30日
一、营业总收入		-234,252,563.20	204,052,761.63
1. 利息收入		2,566,464.43	2,839,945.84
其中：存款利息收入	6.4.7.9	331,387.29	1,300,829.05
债券利息收入		-	557.83
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		2,235,077.14	1,538,558.96
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-25,775,222.94	112,018,287.55

其中：股票投资收益	6.4.7.10	-36,580,838.10	73,842,854.97
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	320,740.96	325,915.52
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-15,353,628.15	20,817,475.73
股利收益	6.4.7.15	25,838,502.35	17,032,041.33
以摊余成本计量的 金融资产终止确认 产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.16	-211,547,990.88	86,533,638.56
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.17	504,186.19	2,660,889.68
减：二、营业总支出		7,222,260.68	9,331,628.89
1. 管理人报酬		5,556,332.82	5,367,706.00
2. 托管费		1,111,266.60	1,073,541.24
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		8,048.77	85,214.97
8. 其他费用	6.4.7.19	546,612.49	2,805,166.68
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		-241,474,823.88	194,721,132.74
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-241,474,823.88	194,721,132.74
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-241,474,823.88	194,721,132.74

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	2,056,408,47 0.00	-	318,258,547. 17	2,374,667,01 7.17
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	2,056,408,47 0.00	-	318,258,547. 17	2,374,667,01 7.17
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	325,000,000. 00	-	-252,865,26 9.16	72,134,730.8 4
（一）、综合收益总额	-	-	-241,474,82 3.88	-241,474,82 3.88
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	325,000,000. 00	-	-11,390,445. 28	313,609,554. 72
其中：1. 基金申购款	457,500,000. 00	-	-2,196,305.9 9	455,303,694. 01

2. 基金赎回款	-132,500,000.00	-	-9,194,139.29	-141,694,139.29
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	2,381,408,470.00	-	65,393,278.01	2,446,801,748.01
项 目	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	2,468,908,470.00	-	-61,038,982.80	2,407,869,487.20
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	2,468,908,470.00	-	-61,038,982.80	2,407,869,487.20
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-315,000,000.00	-	187,618,765.21	-127,381,234.79
(一)、综合收益总额	-	-	194,721,132.74	194,721,132.74
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-315,000,000.00	-	-7,102,367.53	-322,102,367.53
其中：1. 基金申购款	935,000,000.	-	-7,333,949.4	927,666,050.

	00		9	51
2. 基金赎回款	-1,250,000,000.00	-	231,581.96	-1,249,768,418.04
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	2,153,908,470.00	-	126,579,782.41	2,280,488,252.41

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：

郭树强

薄贺龙

薄贺龙

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]1285号《关于准予天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册,由天弘基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币333,867,000.00元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第0673号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2020年8月7日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为333,908,470.00份基金份额,其中认购资金利息折合41,470.00份基金份额。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司,基金托管人为国泰君安证券股份有限公司。

根据《天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,经深圳证券交易所(以下简称

“深交所”)深证上[2020]735号文审核同意,本基金333,908,470.00份基金份额于2020年8月24日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在0.2%以内,年化跟踪误差控制在2%以内。本基金以标的指数成份股和备选成份股为主要投资对象。此外,为更好地实现基金的投资目标,本基金还可以投资于国内依法发行上市的非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票)、存托凭证、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、货币市场工具、同业存单、债券回购、资产支持证券、银行存款、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。基金的投资组合比例为:本基金投资于标的指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%,且不低于非现金基金资产的80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金;股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为:中证500指数收益率。

本基金的基金管理人天弘基金管理有限公司以本基金为目标ETF,将原天弘中证500指数型发起式证券投资基金转型为天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“天弘中证500ETF联接”)。天弘中证500ETF联接为契约型开放式基金,投资目标与本基金类似,将绝大多数基金资产投资于本基金。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2022年度上半年财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2022年06月30日的财务状况以及2022年度上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

除6.4.4.1、6.4.4.2、6.4.4.3之外，本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

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

(1) 金融资产

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

债务工具

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

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

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

(2) 金融负债

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

(3) 衍生金融工具

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

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

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

(1) 金融资产的分类

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

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

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

(2) 金融负债的分类

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

6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

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

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

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

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

新金融工具准则

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

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

原金融工具准则（截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则）

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

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增

值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》及《企业会计准则第37号—金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于2022年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和中期报告〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金2022年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整2022年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021年度的比较财务报表未重列。于2021年12月31日及2022年1月1日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

(i) 于2022年1月1日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、应收证券清算款和应收股利，金额分别为45,464,854.58元、116,832,783.44元、25,430,838.76元、284,867.79元、260,190.17元和539.00元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息、应收清算款和应收股利，金额分别为45,498,140.58元、117,014,409.63元、25,431,156.33元、69,613.97元、260,190.17元和539.00元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为2,190,227,299.39元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为2,190,227,323.45元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为1,304,905.52元、1,015,836.23元、203,167.27元、629,042.63元和192,180.91元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为1,304,905.52元、1,015,836.23元、203,167.27元、629,042.63元和192,180.91元。

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

(b) 修订后的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》

根据中国证监会于2022年颁布的修订后的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2022年06月30日
活期存款	25,995,130.97
等于：本金	25,984,838.35
加：应计利息	10,292.62
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	25,995,130.97

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	2,461,088,353.19	-	2,343,729,662.38	-117,358,690.81	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	146,500.00	27.61	146,527.61	-
	银行间市场	-	-	-	-

	合计	146,500.00	27.61	146,527.61	-
	资产支持证券	-	-	-	-
	基金	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	2,461,234,85 3.19	27.61	2,343,876,18 9.99	-117,358,690. 81

注：1、股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

2、股票投资的成本、公允价值及公允价值变动均包含中国存托凭证的成本、公允价值及公允价值变动。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	93,228,040.00	-	-	-
股指期货	93,228,040.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	93,228,040.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2207	IC2207	66.00	84,936,720.00	4,452,440.00
IC2208	IC2208	10.00	12,792,400.00	48,640.00
合计				4,501,080.00
减：可抵销 期货暂收				4,501,080.00

款				
净额				-

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

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
应收利息	-
其他应收款	54,488.40
待摊费用	75,616.24
合计	130,104.64

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	412,413.79
其中：交易所市场	412,413.79
银行间市场	-

应付利息	-
预提费用	238,848.72
其他应付	166,735.63
合计	817,998.14

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,056,408,470.00	2,056,408,470.00
本期申购	457,500,000.00	457,500,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-132,500,000.00	-132,500,000.00
本期末	2,381,408,470.00	2,381,408,470.00

6.4.7.8 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
本期期初	221,084,103.98	97,174,443.19	318,258,547.17
本期利润	-29,926,833.00	-211,547,990.88	-241,474,823.88
本期基金份额交易产生的变动数	34,270,941.15	-45,661,386.43	-11,390,445.28
其中：基金申购款	47,934,406.35	-50,130,712.34	-2,196,305.99
基金赎回款	-13,663,465.20	4,469,325.91	-9,194,139.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	225,428,212.13	-160,034,934.12	65,393,278.01

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
	活期存款利息收入

定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	81,601.68
其他	4,114.04
合计	331,387.29

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-33,890,323.87
股票投资收益——赎回差价收入	-2,690,514.23
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	-36,580,838.10

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
卖出股票成交总额	518,528,075.47
减：卖出股票成本总额	551,187,382.49
减：交易费用	1,231,016.85
买卖股票差价收入	-33,890,323.87

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
赎回基金份额对价总额	141,694,139.29
减：现金支付赎回款总额	72,224,700.29

减：赎回股票成本总额	72,159,953.23
减：交易费用	-
赎回差价收入	-2,690,514.23

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
债券投资收益——利息收入	430.44
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	320,310.52
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	320,740.96

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,968,713.33
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,647,900.00
减：应计利息总额	439.88
减：交易费用	62.93
买卖债券差价收入	320,310.52

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期未取得资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期未取得贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益**6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期未取得买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2022年01月01日至2022年06月30日
期货投资	-15,353,628.15

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
股票投资产生的股利收益	25,838,502.35
其中：证券出借权益补偿收入	2,097,684.72
基金投资产生的股利收益	-
合计	25,838,502.35

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
1. 交易性金融资产	-214,125,190.88
——股票投资	-214,124,894.78
——债券投资	-296.10
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	2,577,200.00

——权证投资	-
——期货投资	2,577,200.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-211,547,990.88

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
基金赎回费收入	-
基金转换费收入	-
ETF基金替代损益	504,186.19
延期合约递延费收入	-
合计	504,186.19

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内未发生信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	49,588.57
证券出借违约金	-
指数使用费	333,380.01
IOPV计算发布费	49,588.57
ETF登记结算费	74,383.76
合计	546,612.49

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
天弘基金管理有限公司	基金管理人
国泰君安证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金	本基金的联接基金

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2022年01月01日至2022年06月30日	2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,556,332.82	5,367,706.00
其中：支付销售机构的客户维护费	681.06	2,821.93

注：1、支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值0.50%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×该日适用费率/当年天数。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,111,266.60	1,073,541.24

注：支付基金托管人国泰君安证券股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

单位：人民币元

本期 2022年01月01日至2022年06月30日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额

国泰君安证券股份有 限公司	921,540,47 0.00	585,767. 37	24,816,468.00	-
上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业 务余额	期末应收利息 余额
-	-	-	-	-

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

单位：人民币元

本期 2022年01月01日至2022年06月30日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量(股)	出借期限(天)	费率	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
国泰君安证券股份有限公司	2022010400000862	华策影视	2022-01-04	17,496.00	2,400	14	3.40%	22.46	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022010500001410	万孚生物	2022-01-05	39,410.00	1,000	14	3.40%	50.59	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022011400020094	华策影视	2022-01-14	155,949.00	22,900	14	3.20%	188.42	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022011400020096	汤臣倍健	2022-01-14	444,942.00	17,100	14	3.20%	537.58	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022011400020098	信维通信	2022-01-14	455,520.00	19,500	14	3.20%	550.36	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022011400020100	新宙邦	2022-01-14	594,624.00	5,700	14	3.20%	718.43	-	-
国泰君	2022011	机器人	2022-01	280,22	25,200	14	3.20%	338.56	-	-

安证券股份有限公司	400020102		-14	4.00							
国泰君安证券股份有限公司	2022011400020104	红日药业	2022-01-14	301,908.00	36,200	14	3.20%	364.77	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022011400020106	网宿科技	2022-01-14	331,474.00	49,400	14	3.20%	400.49	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022011400020108	安科生物	2022-01-14	324,786.00	23,100	14	3.20%	392.41	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022011400020110	捷成股份	2022-01-14	291,616.00	41,600	14	3.20%	352.33	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022011400020112	寒锐钴业	2022-01-14	335,959.00	4,300	14	3.20%	405.90	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022011400020114	普利制药	2022-01-14	267,800.00	5,200	14	3.20%	323.55	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022011400020116	万孚生物	2022-01-14	371,380.00	6,200	14	3.20%	448.70	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022011400020118	昆仑万维	2022-01-14	432,899.00	19,300	14	3.20%	523.03	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022011400020120	迈克生物	2022-01-14	304,202.00	8,900	14	3.20%	367.53	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022011400020122	康泰医学	2022-01-14	101,976.00	2,400	14	3.20%	123.20	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022011400020124	光威复材	2022-01-14	452,042.00	6,200	14	3.20%	546.16	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022011400020126	迈为股份	2022-01-14	543,910.00	1,000	14	3.20%	657.16	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022011400020128	光环新网	2022-01-14	367,275.00	24,900	14	3.20%	443.74	-	-	

国泰君安证券股份有限公司	2022011400020130	卫宁健康	2022-01-14	516,578.00	34,600	14	3.20%	624.13	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022011400020132	华宇软件	2022-01-14	205,744.00	16,700	14	3.20%	248.58	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022011400021950	长信科技	2022-01-14	586,575.00	49,500	14	3.20%	708.70	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022011400021952	长盈精密	2022-01-14	286,624.00	16,900	14	3.20%	346.30	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022011400021954	海新能科	2022-01-14	223,508.00	28,400	14	3.20%	270.04	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022011400021956	东方国信	2022-01-14	176,742.00	16,200	14	3.20%	213.54	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022011400021958	蓝色光标	2022-01-14	531,116.00	50,200	14	3.20%	641.69	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022011400021960	万达信息	2022-01-14	276,284.00	23,900	14	3.20%	333.81	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022011400021962	碧水源	2022-01-14	319,782.00	44,600	14	3.20%	386.36	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022011400021964	圣湘生物	2022-01-14	180,192.00	2,400	14	3.20%	217.71	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022011400021966	凯赛生物	2022-01-14	388,752.00	2,400	14	3.20%	469.69	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022011400021968	虹软科技	2022-01-14	164,680.00	4,000	14	3.20%	198.97	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022011400021970	南微医学	2022-01-14	177,060.00	1,000	14	3.20%	213.92	-	-
国泰君安股份有	2022011400022836	易华录	2022-01-14	211,184.00	6,700	14	3.20%	255.16	-	-

有限公司										
国泰君安证券股份有限公司	2022011 4000228 38	迪安诊断	2022-01 -14	337,21 2.00	8,700	14	3.20%	407.42	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022011 4000228 40	中际旭创	2022-01 -14	437,58 4.00	11,200	14	3.20%	528.69	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022011 4000228 42	国瓷材料	2022-01 -14	673,11 0.00	16,200	14	3.20%	813.25	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022011 4000228 44	光线传媒	2022-01 -14	269,04 0.00	23,600	14	3.20%	325.06	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022011 4000228 46	掌趣科技	2022-01 -14	261,87 6.00	55,600	14	3.20%	316.40	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022011 4000228 48	我武生物	2022-01 -14	331,44 3.00	6,300	14	3.20%	400.45	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022011 4000228 50	博腾股份	2022-01 -14	518,05 0.00	6,500	14	3.20%	625.90	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022012 8000195 62	博腾股份	2022-01 -28	505,63 5.00	6,500	14	3.20%	610.90	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022012 8000195 64	我武生物	2022-01 -28	290,17 8.00	6,300	14	3.20%	350.59	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022012 8000195 66	掌趣科技	2022-01 -28	206,27 6.00	55,600	14	3.20%	249.22	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022012 8000195 68	光线传媒	2022-01 -28	248,50 8.00	23,600	14	3.20%	300.24	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022012 8000195 70	国瓷材料	2022-01 -28	649,62 0.00	16,200	14	3.20%	784.87	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022012 8000195 72	中际旭创	2022-01 -28	400,96 0.00	11,200	14	3.20%	484.44	-	-
国泰君安证券	2022012 8000195	迪安诊断	2022-01 -28	254,47 5.00	8,700	14	3.20%	307.46	-	-

股份有限公司	74									
国泰君安证券股份有限公司	2022012800019576	易华录	2022-01-28	184,250.00	6,700	14	3.20%	222.61	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022012800019578	南微医学	2022-01-28	154,810.00	1,000	14	3.20%	187.04	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022012800019580	虹软科技	2022-01-28	154,120.00	4,000	14	3.20%	186.20	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022012800019582	凯赛生物	2022-01-28	379,200.00	2,400	14	3.20%	458.15	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022012800019584	圣湘生物	2022-01-28	125,592.00	2,400	14	3.20%	151.74	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022012800019586	碧水源	2022-01-28	293,914.00	44,600	14	3.20%	355.11	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022012800019588	万达信息	2022-01-28	281,303.00	23,900	14	3.20%	339.87	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022012800019590	蓝色光标	2022-01-28	439,752.00	50,200	14	3.20%	531.31	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022012800019592	东方国信	2022-01-28	185,328.00	16,200	14	3.20%	223.91	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022012800019594	海新能科	2022-01-28	220,100.00	28,400	14	3.20%	265.92	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022012800019596	长盈精密	2022-01-28	236,431.00	16,900	14	3.20%	285.66	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022012800019598	长信科技	2022-01-28	505,395.00	49,500	14	3.20%	610.62	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022012800019600	华宇软件	2022-01-28	191,716.00	16,700	14	3.20%	231.63	-	-
国泰君安	2022012	卫宁健	2022-01	398,24	34,600	14	3.20%	481.16	-	-

安证券股份有限公司	800019602	康	-28	6.00							
国泰君安证券股份有限公司	2022012800019604	光环新网	2022-01-28	331,419.00	24,900	14	3.20%	400.42	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022012800019606	迈为股份	2022-01-28	491,710.00	1,000	14	3.20%	594.09	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022012800019608	光威复材	2022-01-28	445,904.00	6,200	14	3.20%	538.74	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022012800019610	康泰医学	2022-01-28	80,496.00	2,400	14	3.20%	97.25	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022012800019612	迈克生物	2022-01-28	221,877.00	8,900	14	3.20%	268.07	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022012800019614	昆仑万维	2022-01-28	361,875.00	19,300	14	3.20%	437.21	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022012800019616	万孚生物	2022-01-28	226,920.00	6,200	14	3.20%	274.16	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022012800019618	普利制药	2022-01-28	248,040.00	5,200	14	3.20%	299.68	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022012800019620	寒锐钴业	2022-01-28	303,279.00	4,300	14	3.20%	366.42	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022012800019622	捷成股份	2022-01-28	263,744.00	41,600	14	3.20%	318.65	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022012800019624	安科生物	2022-01-28	242,550.00	23,100	14	3.20%	293.05	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022012800019626	网宿科技	2022-01-28	286,520.00	49,400	14	3.20%	346.17	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022012800019628	红日药业	2022-01-28	223,354.00	36,200	14	3.20%	269.85	-	-	

国泰君安证券股份有限公司	2022012800019630	机器人	2022-01-28	254,772.00	25,200	14	3.20%	307.82	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022012800019632	新宙邦	2022-01-28	538,821.00	5,700	14	3.20%	651.00	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022012800021662	信维通信	2022-01-28	415,155.00	19,500	14	3.20%	501.59	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022012800021664	华策影视	2022-01-28	136,942.00	22,900	14	3.20%	165.46	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022012800021666	汤臣倍健	2022-01-28	429,210.00	17,100	14	3.20%	518.57	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202202100019222	汤臣倍健	2022-02-11	452,979.00	17,100	14	3.20%	547.29	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202202100019224	华策影视	2022-02-11	135,339.00	22,900	14	3.20%	163.51	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202202100019226	信维通信	2022-02-11	425,685.00	19,500	14	3.20%	514.31	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202202100019228	新宙邦	2022-02-11	503,880.00	5,700	14	3.20%	608.79	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202202100019230	红日药业	2022-02-11	218,286.00	36,200	14	3.20%	263.73	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202202100019232	网宿科技	2022-02-11	305,786.00	49,400	14	3.20%	369.45	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202202100019234	安科生物	2022-02-11	240,240.00	23,100	14	3.20%	290.26	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202202100019236	捷成股份	2022-02-11	293,280.00	41,600	14	3.20%	354.34	-	-
国泰君安股份有	202202100019238	寒锐钴业	2022-02-11	323,102.00	4,300	14	3.20%	390.37	-	-

有限公司										
国泰君安证券股份有限公司	2022021 1000192 40	普利制药	2022-02 -11	227,70 8.00	5,200	14	3.20%	275.12	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022021 1000192 42	万孚生物	2022-02 -11	215,51 2.00	6,200	14	3.20%	260.38	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022021 1000192 44	昆仑万维	2022-02 -11	356,85 7.00	19,300	14	3.20%	431.16	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022021 1000192 46	迈克生物	2022-02 -11	234,42 6.00	8,900	14	3.20%	283.23	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022021 1000192 48	康泰医学	2022-02 -11	79,992. 00	2,400	14	3.20%	96.65	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022021 1000192 50	光威复材	2022-02 -11	412,23 8.00	6,200	14	3.20%	498.07	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022021 1000192 52	迈为股份	2022-02 -11	455,80 0.00	1,000	14	3.20%	550.70	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022021 1000192 54	光环新网	2022-02 -11	346,60 8.00	24,900	14	3.20%	418.77	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022021 1000192 56	卫宁健康	2022-02 -11	399,28 4.00	34,600	14	3.20%	482.42	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022021 1000192 58	华宇软件	2022-02 -11	195,89 1.00	16,700	14	3.20%	236.68	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022021 1000192 60	长信科技	2022-02 -11	465,30 0.00	49,500	14	3.20%	562.17	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022021 1000192 62	长盈精密	2022-02 -11	202,80 0.00	16,900	14	3.20%	245.02	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022021 1000192 64	海新能科	2022-02 -11	227,76 8.00	28,400	14	3.20%	275.18	-	-
国泰君安证券	2022021 1000192	东方国信	2022-02 -11	208,98 0.00	16,200	14	3.20%	252.49	-	-

股份有限公司	66									
国泰君安证券股份有限公司	2022021 1000192 68	蓝色光标	2022-02 -11	402,60 4.00	50,200	14	3.20%	486.43	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022021 1000192 70	万达信息	2022-02 -11	298,75 0.00	23,900	14	3.20%	360.95	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022021 1000192 72	碧水源	2022-02 -11	314,43 0.00	44,600	14	3.20%	379.89	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022021 1000192 74	圣湘生物	2022-02 -11	116,61 6.00	2,400	14	3.20%	140.89	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022021 1000192 76	凯赛生物	2022-02 -11	344,59 2.00	2,400	14	3.20%	416.34	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022021 1000192 78	虹软科技	2022-02 -11	151,88 0.00	4,000	14	3.20%	183.50	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022021 1000192 80	南微医学	2022-02 -11	150,92 0.00	1,000	14	3.20%	182.34	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022021 1000192 82	易华录	2022-02 -11	175,87 5.00	6,700	14	3.20%	212.49	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022021 1000192 84	迪安诊断	2022-02 -11	246,12 3.00	8,700	14	3.20%	297.37	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022021 1000192 86	中际旭创	2022-02 -11	389,08 8.00	11,200	14	3.20%	470.10	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022021 1000192 88	国瓷材料	2022-02 -11	669,06 0.00	16,200	14	3.20%	808.36	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022021 1000192 90	光线传媒	2022-02 -11	235,52 8.00	23,600	14	3.20%	284.56	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022021 1000192 92	掌趣科技	2022-02 -11	218,50 8.00	55,600	14	3.20%	264.00	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022021	我武生	2022-02	269,38	6,300	14	3.20%	325.48	-	-

安证券股份有限公司	1000192 94	物	-11	8.00							
国泰君安证券股份有限公司	2022021 1000192 96	博腾股份	2022-02 -11	398,58 0.00	6,500	14	3.20%	481.56	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022022 5000164 87	华宇软件	2022-02 -25	191,38 2.00	16,700	14	3.20%	231.22	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022022 5000164 89	卫宁健康	2022-02 -25	395,13 2.00	34,600	14	3.20%	477.40	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022022 5000164 91	光环新网	2022-02 -25	373,50 0.00	24,900	14	3.20%	451.26	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022022 5000164 93	迈为股份	2022-02 -25	536,08 0.00	1,000	14	3.20%	647.69	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022022 5000164 95	光威复材	2022-02 -25	450,18 2.00	6,200	14	3.20%	543.91	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022022 5000164 97	康泰医学	2022-02 -25	91,272. 00	2,400	14	3.20%	110.27	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022022 5000164 99	迈克生物	2022-02 -25	241,01 2.00	8,900	14	3.20%	291.19	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022022 5000165 01	昆仑万维	2022-02 -25	338,71 5.00	19,300	14	3.20%	409.23	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022022 5000165 03	万孚生物	2022-02 -25	267,03 4.00	6,200	14	3.20%	322.63	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022022 5000165 05	普利制药	2022-02 -25	253,70 8.00	5,200	14	3.20%	306.53	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022022 5000165 07	寒锐钴业	2022-02 -25	335,05 6.00	4,300	14	3.20%	404.82	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022022 5000165 09	捷成股份	2022-02 -25	241,69 6.00	41,600	14	3.20%	292.02	-	-	

国泰君安证券股份有限公司	2022022 5000165 11	安科生物	2022-02 -25	247,86 3.00	23,100	14	3.20%	299.47	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022022 5000165 13	网宿科技	2022-02 -25	338,88 4.00	49,400	14	3.20%	409.44	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022022 5000165 15	红日药业	2022-02 -25	245,07 4.00	36,200	14	3.20%	296.10	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022022 5000165 17	新宙邦	2022-02 -25	540,64 5.00	5,700	14	3.20%	653.20	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022022 5000165 19	信维通信	2022-02 -25	416,32 5.00	19,500	14	3.20%	503.00	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022022 5000165 21	华策影视	2022-02 -25	128,24 0.00	22,900	14	3.20%	154.94	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022022 5000165 23	汤臣倍健	2022-02 -25	422,02 8.00	17,100	14	3.20%	509.89	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022022 5000167 89	博腾股份	2022-02 -25	519,02 5.00	6,500	14	3.20%	627.09	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022022 5000167 91	我武生物	2022-02 -25	282,74 4.00	6,300	14	3.20%	341.61	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022022 5000167 93	掌趣科技	2022-02 -25	206,83 2.00	55,600	14	3.20%	249.89	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022022 5000167 95	光线传媒	2022-02 -25	223,49 2.00	23,600	14	3.20%	270.02	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022022 5000167 97	国瓷材料	2022-02 -25	589,35 6.00	16,200	14	3.20%	712.06	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022022 5000167 99	中际旭创	2022-02 -25	415,18 4.00	11,200	14	3.20%	501.62	-	-
国泰君安股份有	2022022 5000168 01	迪安诊断	2022-02 -25	264,48 0.00	8,700	14	3.20%	319.54	-	-

有限公司											
国泰君安证券股份有限公司	2022022 5000168 03	易华录	2022-02 -25	187,73 4.00	6,700	14	3.20%	226.82	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022022 5000168 05	南微医学	2022-02 -25	154,79 0.00	1,000	14	3.20%	187.02	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022022 5000168 07	虹软科技	2022-02 -25	150,36 0.00	4,000	14	3.20%	181.66	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022022 5000168 09	凯赛生物	2022-02 -25	349,20 0.00	2,400	14	3.20%	421.90	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022022 5000168 11	圣湘生物	2022-02 -25	118,96 8.00	2,400	14	3.20%	143.74	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022022 5000168 13	碧水源	2022-02 -25	297,48 2.00	44,600	14	3.20%	359.42	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022022 5000168 15	万达信息	2022-02 -25	300,42 3.00	23,900	14	3.20%	362.97	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022022 5000168 17	东方国信	2022-02 -25	219,67 2.00	16,200	14	3.20%	265.41	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022022 5000168 19	蓝色光标	2022-02 -25	393,56 8.00	50,200	14	3.20%	475.50	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022022 5000168 21	海新能科	2022-02 -25	229,18 8.00	28,400	14	3.20%	276.90	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022022 5000168 23	长盈精密	2022-02 -25	205,16 6.00	16,900	14	3.20%	247.88	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022022 5000168 25	长信科技	2022-02 -25	480,15 0.00	49,500	14	3.20%	580.12	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022031 1000161 12	长信科技	2022-03 -11	428,67 0.00	49,500	14	3.20%	517.92	-	-	
国泰君安证券	2022031 1000161	长盈精密	2022-03 -11	181,67 5.00	16,900	14	3.20%	219.49	-	-	

股份有限公司	14									
国泰君安证券股份有限公司	2022031 1000161 16	海新能科	2022-03 -11	193,68 8.00	28,400	14	3.20%	234.01	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022031 1000161 18	蓝色光标	2022-03 -11	389,55 2.00	50,200	14	3.20%	470.66	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022031 1000161 20	东方国信	2022-03 -11	211,08 6.00	16,200	14	3.20%	255.03	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022031 1000161 22	万达信息	2022-03 -11	271,98 2.00	23,900	14	3.20%	328.61	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022031 1000161 24	碧水源	2022-03 -11	272,95 2.00	44,600	14	3.20%	329.78	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022031 1000161 26	圣湘生物	2022-03 -11	116,40 0.00	2,400	14	3.20%	140.63	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022031 1000161 28	凯赛生物	2022-03 -11	269,44 8.00	2,400	14	3.20%	325.54	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022031 1000161 30	虹软科技	2022-03 -11	124,08 0.00	4,000	14	3.20%	149.91	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022031 1000161 32	南微医学	2022-03 -11	137,62 0.00	1,000	14	3.20%	166.27	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022031 1000161 34	易华录	2022-03 -11	169,57 7.00	6,700	14	3.20%	204.88	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022031 1000161 36	迪安诊断	2022-03 -11	265,87 2.00	8,700	14	3.20%	321.22	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022031 1000161 38	中际旭创	2022-03 -11	396,36 8.00	11,200	14	3.20%	478.89	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022031 1000161 40	国瓷材料	2022-03 -11	571,21 2.00	16,200	14	3.20%	690.14	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022031	光线传媒	2022-03	205,08	23,600	14	3.20%	247.79	-	-

安证券股份有限公司	1000164 34	媒	-11	4.00							
国泰君安证券股份有限公司	2022031 1000164 36	掌趣科技	2022-03 -11	200,16 0.00	55,600	14	3.20%	241.84	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022031 1000164 38	我武生物	2022-03 -11	255,33 9.00	6,300	14	3.20%	308.50	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022031 1000164 40	博腾股份	2022-03 -11	591,63 0.00	6,500	14	3.20%	714.81	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022031 1000164 42	汤臣倍健	2022-03 -11	389,53 8.00	17,100	14	3.20%	470.64	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022031 1000164 44	华策影视	2022-03 -11	117,47 7.00	22,900	14	3.20%	141.93	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022031 1000164 46	信维通信	2022-03 -11	379,47 0.00	19,500	14	3.20%	458.48	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022031 1000164 48	新宙邦	2022-03 -11	485,92 5.00	5,700	14	3.20%	587.10	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022031 1000164 50	红日药业	2022-03 -11	241,45 4.00	36,200	14	3.20%	291.73	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022031 1000164 52	网宿科技	2022-03 -11	309,73 8.00	49,400	14	3.20%	374.22	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022031 1000164 54	安科生物	2022-03 -11	240,24 0.00	23,100	14	3.20%	290.26	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022031 1000164 56	捷成股份	2022-03 -11	232,96 0.00	41,600	14	3.20%	281.47	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022031 1000164 58	寒锐钴业	2022-03 -11	293,77 6.00	4,300	14	3.20%	354.94	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022031 1000164 60	普利制药	2022-03 -11	244,40 0.00	5,200	14	3.20%	295.28	-	-	

国泰君安证券股份有限公司	2022031 1000164 62	万孚生物	2022-03 -11	370,512.00	6,200	14	3.20%	447.65	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022031 1000164 64	昆仑万维	2022-03 -11	328,293.00	19,300	14	3.20%	396.64	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022031 1000164 66	迈克生物	2022-03 -11	246,708.00	8,900	14	3.20%	298.07	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022031 1000164 68	康泰医学	2022-03 -11	98,712.00	2,400	14	3.20%	119.26	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022031 1000164 70	光威复材	2022-03 -11	419,430.00	6,200	14	3.20%	506.76	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022031 1000164 72	迈为股份	2022-03 -11	546,540.00	1,000	14	3.20%	660.33	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022031 1000164 74	光环新网	2022-03 -11	358,062.00	24,900	14	3.20%	432.61	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022031 1000164 76	卫宁健康	2022-03 -11	344,962.00	34,600	14	3.20%	416.79	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022031 1000164 78	华宇软件	2022-03 -11	174,348.00	16,700	14	3.20%	210.65	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022032 5000147 76	华宇软件	2022-03 -25	162,992.00	16,700	14	3.20%	196.92	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022032 5000147 78	卫宁健康	2022-03 -25	324,894.00	34,600	14	3.20%	392.53	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022032 5000147 80	光环新网	2022-03 -25	329,676.00	24,900	14	3.20%	398.31	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022032 5000147 82	迈为股份	2022-03 -25	489,390.00	1,000	14	3.20%	591.28	-	-
国泰君安股份有	2022032 5000147 84	光威复材	2022-03 -25	380,432.00	6,200	14	3.20%	459.64	-	-

限公司										
国泰君安证券股份有限公司	2022032500014786	康泰医学	2022-03-25	82,560.00	2,400	14	3.20%	99.75	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022032500014788	迈克生物	2022-03-25	222,322.00	8,900	14	3.20%	268.61	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022032500014790	昆仑万维	2022-03-25	321,152.00	19,300	14	3.20%	388.02	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022032500014792	万孚生物	2022-03-25	293,942.00	6,200	14	3.20%	355.14	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022032500014794	普利制药	2022-03-25	232,284.00	5,200	14	3.20%	280.64	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022032500014796	寒锐钴业	2022-03-25	277,393.00	4,300	14	3.20%	335.15	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022032500014798	捷成股份	2022-03-25	242,944.00	41,600	14	3.20%	293.52	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022032500014800	安科生物	2022-03-25	228,921.00	23,100	14	3.20%	276.58	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022032500014802	网宿科技	2022-03-25	292,448.00	49,400	14	3.20%	353.34	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022032500014804	红日药业	2022-03-25	282,722.00	36,200	14	3.20%	341.58	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022032500014806	新宙邦	2022-03-25	461,586.00	5,700	14	3.20%	557.69	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022032500014808	信维通信	2022-03-25	358,800.00	19,500	14	3.20%	433.50	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022032500014990	华策影视	2022-03-25	113,813.00	22,900	14	3.20%	137.50	-	-
国泰君安证券	20220325000149	汤臣倍健	2022-03-25	358,416.00	17,100	14	3.20%	433.04	-	-

股份有限公司	92									
国泰君安证券股份有限公司	2022032500014994	博腾股份	2022-03-25	609,180.00	6,500	14	3.20%	736.01	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022032500014996	掌趣科技	2022-03-25	198,492.00	55,600	14	3.20%	239.82	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022032500014998	我武生物	2022-03-25	247,590.00	6,300	14	3.20%	299.14	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022032500015000	光线传媒	2022-03-25	188,092.00	23,600	14	3.20%	227.25	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022032500015002	国瓷材料	2022-03-25	554,040.00	16,200	14	3.20%	669.39	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022032500015004	中际旭创	2022-03-25	360,640.00	11,200	14	3.20%	435.73	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022032500015006	迪安诊断	2022-03-25	238,989.00	8,700	14	3.20%	288.75	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022032500015008	易华录	2022-03-25	149,075.00	6,700	14	3.20%	180.12	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022032500015010	南微医学	2022-03-25	127,330.00	1,000	14	3.20%	153.84	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022032500015012	虹软科技	2022-03-25	117,040.00	4,000	14	3.20%	141.41	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022032500015014	凯赛生物	2022-03-25	264,648.00	2,400	14	3.20%	319.75	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022032500015016	圣湘生物	2022-03-25	103,920.00	2,400	14	3.20%	125.55	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022032500015018	碧水源	2022-03-25	260,464.00	44,600	14	3.20%	314.69	-	-
国泰君安	2022032	万达信	2022-03	253,81	23,900	14	3.20%	306.66	-	-

安证券股份有限公司	5000150 20	息	-25	8.00							
国泰君安证券股份有限公司	2022032 5000150 22	东方国 信	2022-03 -25	177,06 6.00	16,200	14	3.20%	213.93	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022032 5000150 24	蓝色光 标	2022-03 -25	408,62 8.00	50,200	14	3.20%	493.70	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022032 5000150 26	海新能 科	2022-03 -25	186,02 0.00	28,400	14	3.20%	224.75	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022032 5000150 28	长信科 技	2022-03 -25	415,80 0.00	49,500	14	3.20%	502.37	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022032 5000150 30	长盈精 密	2022-03 -25	170,01 4.00	16,900	14	3.20%	205.41	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022040 8000154 91	长盈精 密	2022-04 -08	154,63 5.00	16,900	14	3.20%	186.83	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022040 8000154 93	长信科 技	2022-04 -08	364,81 5.00	49,500	14	3.20%	440.77	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022040 8000154 95	海新能 科	2022-04 -08	174,94 4.00	28,400	14	3.20%	211.37	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022040 8000154 97	蓝色光 标	2022-04 -08	419,67 2.00	50,200	14	3.20%	507.05	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022040 8000154 99	东方国 信	2022-04 -08	166,86 0.00	16,200	14	3.20%	201.60	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022040 8000164 51	万达信 息	2022-04 -08	235,89 3.00	23,900	14	3.20%	285.01	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022040 8000164 53	碧水源	2022-04 -08	259,57 2.00	44,600	14	3.20%	313.61	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022040 8000164 55	圣湘生 物	2022-04 -08	102,38 4.00	2,400	14	3.20%	123.70	-	-	

国泰君安证券股份有限公司	2022040800016457	凯赛生物	2022-04-08	260,376.00	2,400	14	3.20%	314.58	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022040800016459	虹软科技	2022-04-08	108,080.00	4,000	14	3.20%	130.58	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022040800016461	南微医学	2022-04-08	115,960.00	1,000	14	3.20%	140.11	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022040800016463	易华录	2022-04-08	128,707.00	6,700	14	3.20%	155.50	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022040800016465	迪安诊断	2022-04-08	238,815.00	8,700	14	3.20%	288.53	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022040800016467	中际旭创	2022-04-08	346,080.00	11,200	14	3.20%	418.14	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022040800016469	国瓷材料	2022-04-08	545,292.00	16,200	14	3.20%	658.83	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022040800016471	光线传媒	2022-04-08	180,068.00	23,600	14	3.20%	217.55	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022040800016473	我武生物	2022-04-08	227,115.00	6,300	14	3.20%	274.40	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022040800016475	掌趣科技	2022-04-08	200,716.00	55,600	14	3.20%	242.50	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022040800016477	博腾股份	2022-04-08	566,150.00	6,500	14	3.20%	684.02	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022040800016479	汤臣倍健	2022-04-08	355,680.00	17,100	14	3.20%	429.73	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022040800016481	华策影视	2022-04-08	112,439.00	22,900	14	3.20%	135.84	-	-
国泰君安股份有	2022040800016483	信维通信	2022-04-08	332,280.00	19,500	14	3.20%	401.46	-	-

有限公司										
国泰君安证券股份有限公司	2022040800016485	新宙邦	2022-04-08	455,259.00	5,700	14	3.20%	550.04	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022040800016487	红日药业	2022-04-08	284,532.00	36,200	14	3.20%	343.77	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022040800016489	网宿科技	2022-04-08	274,170.00	49,400	14	3.20%	331.25	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022040800016491	安科生物	2022-04-08	211,134.00	23,100	14	3.20%	255.09	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022040800016493	捷成股份	2022-04-08	236,704.00	41,600	14	3.20%	285.98	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022040800016495	寒锐钴业	2022-04-08	258,688.00	4,300	14	3.20%	312.54	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022040800016497	普利制药	2022-04-08	218,868.00	5,200	14	3.20%	264.44	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022040800016499	万孚生物	2022-04-08	279,620.00	6,200	14	3.20%	337.84	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022040800016501	昆仑万维	2022-04-08	315,362.00	19,300	14	3.20%	381.02	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022040800016503	迈克生物	2022-04-08	203,009.00	8,900	14	3.20%	245.27	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022040800016505	康泰医学	2022-04-08	75,936.00	2,400	14	3.20%	91.75	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022040800016507	迈为股份	2022-04-08	508,500.00	1,000	14	3.20%	614.37	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022040800016509	光威复材	2022-04-08	334,800.00	6,200	14	3.20%	404.50	-	-
国泰君安证券	20220408000165	光环新网	2022-04-08	314,985.00	24,900	14	3.20%	380.56	-	-

股份有限公司	11									
国泰君安证券股份有限公司	2022040800016513	卫宁健康	2022-04-08	302,750.00	34,600	14	3.20%	365.79	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022040800016515	华宇软件	2022-04-08	152,972.00	16,700	14	3.20%	184.83	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022042200013966	卫宁健康	2022-04-22	267,804.00	34,600	14	3.20%	323.56	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022042200013968	光环新网	2022-04-22	260,454.00	24,900	14	3.20%	314.68	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022042200013970	光威复材	2022-04-22	289,168.00	6,200	14	3.20%	349.37	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022042200013972	迈为股份	2022-04-22	324,110.00	1,000	14	3.20%	391.59	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022042200013974	康泰医学	2022-04-22	68,112.00	2,400	14	3.20%	82.29	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022042200013976	迈克生物	2022-04-22	178,356.00	8,900	14	3.20%	215.49	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022042200013978	昆仑万维	2022-04-22	277,148.00	19,300	14	3.20%	334.85	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022042200013980	万孚生物	2022-04-22	288,796.00	6,200	14	3.20%	348.92	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022042200013982	普利制药	2022-04-22	134,420.00	5,200	14	3.20%	162.41	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022042200013984	寒锐钴业	2022-04-22	231,856.00	4,300	14	3.20%	280.13	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022042200013986	捷成股份	2022-04-22	197,600.00	41,600	14	3.20%	238.74	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022042200013988	安科生	2022-04-22	188,030.00	23,100	14	3.20%	227.18	-	-

安证券股份有限公司	2000139 88	物	-22	4.00							
国泰君安证券股份有限公司	2022042 2000139 90	网宿科技	2022-04 -22	250,45 8.00	49,400	14	3.20%	302.60	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022042 2000139 92	红日药业	2022-04 -22	211,40 8.00	36,200	14	3.20%	255.43	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022042 2000139 94	新宙邦	2022-04 -22	381,61 5.00	5,700	14	3.20%	461.07	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022042 2000139 96	信维通信	2022-04 -22	300,69 0.00	19,500	14	3.20%	363.29	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022042 2000139 98	华策影视	2022-04 -22	102,59 2.00	22,900	14	3.20%	123.95	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022042 2000140 00	汤臣倍健	2022-04 -22	344,56 5.00	17,100	14	3.20%	416.30	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022042 2000140 02	博腾股份	2022-04 -22	493,35 0.00	6,500	14	3.20%	596.07	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022042 2000140 04	掌趣科技	2022-04 -22	184,03 6.00	55,600	14	3.20%	222.35	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022042 2000140 06	我武生物	2022-04 -22	213,88 5.00	6,300	14	3.20%	258.42	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022042 2000140 08	光线传媒	2022-04 -22	161,66 0.00	23,600	14	3.20%	195.32	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022042 2000140 10	国瓷材料	2022-04 -22	490,69 8.00	16,200	14	3.20%	592.86	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022042 2000140 12	中际旭创	2022-04 -22	322,22 4.00	11,200	14	3.20%	389.31	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022042 2000140 14	迪安诊断	2022-04 -22	244,47 0.00	8,700	14	3.20%	295.37	-	-	

国泰君安证券股份有限公司	2022042 2000140 16	南微医学	2022-04 -22	108,14 0.00	1,000	14	3.20%	130.65	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022042 2000140 18	易华录	2022-04 -22	110,34 9.00	6,700	14	3.20%	133.32	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022042 2000140 20	虹软科技	2022-04 -22	98,600. 00	4,000	14	3.20%	119.13	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022042 2000140 22	凯赛生物	2022-04 -22	213,24 0.00	2,400	14	3.20%	257.64	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022042 2000140 24	圣湘生物	2022-04 -22	103,77 6.00	2,400	14	3.20%	125.38	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022042 2000140 26	碧水源	2022-04 -22	223,44 6.00	44,600	14	3.20%	269.97	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022042 2000140 28	万达信息	2022-04 -22	211,75 4.00	23,900	14	3.20%	255.84	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022042 2000140 30	东方国信	2022-04 -22	143,20 8.00	16,200	14	3.20%	173.02	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022042 2000140 32	蓝色光标	2022-04 -22	310,23 6.00	50,200	14	3.20%	374.83	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022042 2000140 34	海新能科	2022-04 -22	134,61 6.00	28,400	14	3.20%	162.64	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022042 2000140 36	长信科技	2022-04 -22	321,75 0.00	49,500	14	3.20%	388.74	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022042 2000140 38	长盈精密	2022-04 -22	134,52 4.00	16,900	14	3.20%	162.53	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022050 6000142 07	长盈精密	2022-05 -06	126,24 3.00	16,900	14	3.20%	152.52	-	-
国泰君安股份有	2022050 6000142 09	长信科技	2022-05 -06	289,57 5.00	49,500	14	3.20%	349.86	-	-

有限公司										
国泰君安证券股份有限公司	2022050600014211	海新能科	2022-05-06	118,428.00	28,400	14	3.20%	143.09	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022050600014213	蓝色光标	2022-05-06	276,100.00	50,200	14	3.20%	333.58	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022050600014215	东方国信	2022-05-06	137,376.00	16,200	14	3.20%	165.98	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022050600014217	万达信息	2022-05-06	196,697.00	23,900	14	3.20%	237.65	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022050600014219	碧水源	2022-05-06	200,254.00	44,600	14	3.20%	241.94	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022050600014221	圣湘生物	2022-05-06	109,200.00	2,400	14	3.20%	131.93	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022050600014223	凯赛生物	2022-05-06	209,976.00	2,400	14	3.20%	253.69	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022050600014225	虹软科技	2022-05-06	89,360.00	4,000	14	3.20%	107.96	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022050600014227	易华录	2022-05-06	99,160.00	6,700	14	3.20%	119.81	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022050600014229	南微医学	2022-05-06	96,080.00	1,000	14	3.20%	116.09	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022050600014231	迪安诊断	2022-05-06	322,857.00	8,700	14	3.20%	390.08	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022050600014233	中际旭创	2022-05-06	357,840.00	11,200	14	3.20%	432.34	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022050600014235	国瓷材料	2022-05-06	513,378.00	16,200	14	3.20%	620.26	-	-
国泰君安证券	20220506000142	光线传媒	2022-05-06	160,244.00	23,600	14	3.20%	193.60	-	-

股份有限公司	37									
国泰君安证券股份有限公司	2022050600014239	我武生物	2022-05-06	278,964.00	6,300	14	3.20%	337.05	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022050600014241	掌趣科技	2022-05-06	161,796.00	55,600	14	3.20%	195.49	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022050600014243	博腾股份	2022-05-06	457,925.00	6,500	14	3.20%	553.26	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022050600014245	汤臣倍健	2022-05-06	332,766.00	17,100	14	3.20%	402.05	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022050600014247	华策影视	2022-05-06	95,493.00	22,900	14	3.20%	115.38	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022050600014249	信维通信	2022-05-06	286,650.00	19,500	14	3.20%	346.33	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022050600014251	新宙邦	2022-05-06	386,802.00	5,700	14	3.20%	467.33	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022050600014253	红日药业	2022-05-06	216,114.00	36,200	14	3.20%	261.11	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022050600014255	网宿科技	2022-05-06	239,096.00	49,400	14	3.20%	288.87	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022050600014257	安科生物	2022-05-06	210,210.00	23,100	14	3.20%	253.97	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022050600014259	捷成股份	2022-05-06	201,760.00	41,600	14	3.20%	243.77	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022050600014261	寒锐钴业	2022-05-06	216,204.00	4,300	14	3.20%	261.21	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022050600014263	普利制药	2022-05-06	142,740.00	5,200	14	3.20%	172.46	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022050600014263	万孚生	2022-05-06	281,230.00	6,200	14	3.20%	339.79	-	-

安证券股份有限公司	6000142 65	物	-06	2.00							
国泰君安证券股份有限公司	2022050 6000142 67	昆仑万维	2022-05 -06	274,83 2.00	19,300	14	3.20%	332.05	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022050 6000142 69	迈克生物	2022-05 -06	172,12 6.00	8,900	14	3.20%	207.96	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022050 6000142 71	康泰医学	2022-05 -06	64,800. 00	2,400	14	3.20%	78.29	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022050 6000142 73	迈为股份	2022-05 -06	321,80 0.00	1,000	14	3.20%	388.80	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022050 6000142 75	光威复材	2022-05 -06	308,07 8.00	6,200	14	3.20%	372.22	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022050 6000142 77	光环新网	2022-05 -06	239,04 0.00	24,900	14	3.20%	288.81	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022050 6000142 79	卫宁健康	2022-05 -06	279,22 2.00	34,600	14	3.20%	337.36	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022063 0000018 33	宋城演艺	2022-06 -30	110,52 0.00	7,200	14	3.20%	-	110,52 0.00	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022063 0000018 36	长信科技	2022-06 -30	200,34 0.00	27,000	14	3.20%	-	200,34 0.00	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022063 0000018 40	碧水源	2022-06 -30	52,100. 00	10,000	14	3.20%	-	52,100. 00	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022063 0000018 46	海新能科	2022-06 -30	102,71 8.00	20,300	14	3.20%	-	102,71 8.00	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022063 0000018 50	汤臣倍健	2022-06 -30	28,145. 00	1,300	14	3.20%	-	28,145. 00	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022063 0000018 60	我武生物	2022-06 -30	62,436. 00	1,200	14	3.20%	-	62,436. 00	-	

国泰君安证券股份有限公司	2022063000001870	昆仑万维	2022-06-30	68,800.00	4,300	14	3.20%	-	68,800.00	-
国泰君安证券股份有限公司	2022063000001874	中际旭创	2022-06-30	68,310.00	2,200	14	3.20%	-	68,310.00	-
国泰君安证券股份有限公司	2022063000001878	光线传媒	2022-06-30	50,191.00	5,300	14	3.20%	-	50,191.00	-
国泰君安证券股份有限公司	2022063000001882	国瓷材料	2022-06-30	132,904.00	3,700	14	3.20%	-	132,904.00	-
国泰君安证券股份有限公司	2022063000001884	卫宁健康	2022-06-30	35,120.00	4,000	14	3.20%	-	35,120.00	-
国泰君安证券股份有限公司	2022063000001910	蓝色光标	2022-06-30	74,442.00	11,400	14	3.20%	-	74,442.00	-
国泰君安证券股份有限公司	2022063000001912	网宿科技	2022-06-30	34,304.00	6,400	14	3.20%	-	34,304.00	-
国泰君安证券股份有限公司	2022063000001916	特锐德	2022-06-30	51,930.00	3,000	14	3.20%	-	51,930.00	-
国泰君安证券股份有限公司	2022063000001918	华测检测	2022-06-30	176,396.00	7,600	14	3.20%	-	176,396.00	-
国泰君安证券股份有限公司	2022063000001922	安科生物	2022-06-30	53,583.00	5,300	14	3.20%	-	53,583.00	-
国泰君安证券股份有限公司	2022063000001930	万孚生物	2022-06-30	48,852.00	1,200	14	3.20%	-	48,852.00	-
国泰君安证券股份有限公司	2022063000001936	光威复材	2022-06-30	82,418.00	1,400	14	3.20%	-	82,418.00	-
国泰君安证券股份有限公司	2022063000001972	杭可科技	2022-06-30	140,120.00	2,000	14	3.20%	-	140,120.00	-
国泰君安股份有	2022063000001974	寒武纪	2022-06-30	155,280.00	2,400	14	3.20%	-	155,280.00	-

有限公司										
国泰君安证券股份有限公司	2022063000001982	南微医学	2022-06-30	95,920.00	1,100	14	3.20%	-	95,920.00	-
上年度可比期间										
2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量(股)	出借期限(天)	费率	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2022年06月30日		上年度末 2021年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金	2,280,267,769.00	95.75%	1,933,324,319.00	94.01%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
国泰君安证券股份有限公司	25,995,130.97	245,671.57	136,317,896.44	1,172,620.29

注：本基金由基金托管人国泰君安证券股份有限公司保管的银行存款，存放在具有基金托管资格的银行，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2022年01月01日至2022年06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：张/股）	总金额
国泰君安证券股份有限公司	301217	铜冠铜箔	网下申购	42,831	739,691.37
国泰君安证券股份有限公司	603070	万控智造	网下申购	775	7,300.50
国泰君安证券股份有限公司	688238	和元生物	网下申购	12,836	169,820.28
国泰君安证券股份有限公司	301258	富士莱	网下申购	2,942	142,098.60
国泰君安证券股份有限公司	301263	泰恩康	网下申购	6,813	135,783.09
国泰君安证券股份有限公司	301097	天益医疗	网下申购	2,486	130,191.82

有限公司					
国泰君安 证券股份 有限公司	301268	铭利达	网下申购	6,407	182,599.50
国泰君安 证券股份 有限公司	301279	金道科技	网下申购	2,956	92,227.20
国泰君安 证券股份 有限公司	688120	华海清科	网下申购	4,822	658,974.52
国泰君安 证券股份 有限公司	688234	天岳先进	网下申购	6,759	559,577.61
上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06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：张 /股）	总金额
国泰君安 证券股份 有限公司	605005	合兴股份	网下申购	634	4,044.92
国泰君安 证券股份 有限公司	688070	纵横股份	网下申购	2,407	55,746.12
国泰君安 证券股份 有限公司	688677	海泰新光	网下申购	1,768	63,223.68
国泰君安 证券股份 有限公司	605089	味知香	网下申购	370	10,556.10
国泰君安 证券股份 有限公司	605180	华生科技	网下申购	384	8,593.92

国泰君安证券股份有限公司	688395	正弦电气	网下申购	1,627	25,950.65
国泰君安证券股份有限公司	605319	无锡振华	网下申购	764	8,572.08
国泰君安证券股份有限公司	301009	可靠股份	网下申购	8,007	100,407.78
国泰君安证券股份有限公司	688276	百克生物	网下申购	3,486	126,716.10
国泰君安证券股份有限公司	688087	英科再生	网下申购	2,469	54,219.24

6.4.10.8 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。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2022年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688400	凌云光	2022-06-27	1个月内（含）	新股未上市	21.93	21.93	13,111	287,524.23	287,524.23	-
688320	禾川科技	2022-04-	6个月	科创板打	23.66	46.21	6,048	143,095.	279,478.	-

		21		新限售				68	08	
301175	中科环保	2022-06-30	1个月内(含)	新股未上市	3.82	3.82	63,694	243,311.08	243,311.08	-
301139	元道通信	2022-06-30	1个月内(含)	新股未上市	38.46	38.46	5,651	217,337.46	217,337.46	-
301239	普瑞眼科	2022-06-22	1个月内(含)	新股未上市	33.65	33.65	5,747	193,386.55	193,386.55	-
688251	井松智能	2022-05-27	6个月	科创板打新限售	35.62	36.66	3,392	120,823.04	124,350.72	-
688237	超卓航科	2022-06-24	1个月内(含)	新股未上市	41.27	41.27	2,891	119,311.57	119,311.57	-
301238	瑞泰新材	2022-06-10	6个月	创业板打新限售	19.18	32.07	3,497	67,072.46	112,148.79	-
688283	坤恒顺维	2022-02-08	6个月	科创板打新限售	33.80	45.41	1,595	53,911.00	72,428.95	-
301233	盛帮股份	2022-06-24	1个月内(含)	新股未上市	41.52	41.52	1,576	65,435.52	65,435.52	-
301217	铜冠铜箔	2022-01-20	6个月	创业板打新限售	17.27	14.83	4,284	73,984.68	63,531.72	-

301219	腾远钴业	2022-03-10	6个月	创业板打新限售	173.98	87.82	578	55,847.58	50,759.96	-
301200	大族数控	2022-02-18	6个月	创业板打新限售	76.56	51.92	857	65,611.92	44,495.44	-
301206	三元生物	2022-01-26	6个月	创业板打新限售	109.30	45.69	945	68,859.00	43,177.05	-
301216	万凯新材	2022-03-21	6个月	创业板打新限售	35.68	29.84	1,120	39,961.60	33,420.80	-
301207	华兰疫苗	2022-02-10	6个月	创业板打新限售	56.88	56.42	569	32,364.72	32,102.98	-
301215	中汽股份	2022-02-28	6个月	创业板打新限售	3.80	6.39	4,743	18,023.40	30,307.77	-
301109	军信股份	2022-04-06	6个月	创业板打新限售	34.81	16.14	1,838	42,642.25	29,665.32	-
301302	华如科技	2022-06-16	6个月	创业板打新限售	52.03	56.42	466	24,245.98	26,291.72	-
301266	宇邦新材	2022-05-	6个月	创业板打	26.86	47.07	517	13,886.6	24,335.1	-

		30		新限售				2	9	
301268	铭利达	2022-03-29	6个月	创业板打新限售	28.50	34.87	641	18,268.50	22,351.67	-
301263	泰恩康	2022-03-22	6个月	创业板打新限售	19.93	31.38	682	13,592.26	21,401.16	-
301102	兆讯传媒	2022-03-15	6个月	创业板打新限售	39.88	31.09	642	25,602.96	19,959.78	-
301187	欧圣电气	2022-04-13	6个月	创业板打新限售	21.33	22.54	876	18,685.08	19,745.04	-
301256	华融化学	2022-03-14	6个月	创业板打新限售	8.05	10.08	1,831	14,739.55	18,456.48	-
301112	C信邦	2022-06-20	6个月	创业板打新限售	27.53	45.04	399	10,984.47	17,970.96	-
301153	中科江南	2022-05-10	6个月	创业板打新限售	33.68	43.98	398	13,404.64	17,504.04	-
301123	奕东电子	2022-01-14	6个月	创业板打新限售	37.23	25.39	656	24,422.88	16,655.84	-

301103	何氏眼科	2022-03-14	6个月	创业板打新限售	42.50	32.02	507	16,575.00	16,234.14	-
301120	新特电气	2022-04-11	6个月	创业板打新限售	13.73	15.49	1,032	14,169.36	15,985.68	-
301235	华康医疗	2022-01-21	6个月	创业板打新限售	39.30	37.93	418	16,427.40	15,854.74	-
301286	侨源股份	2022-06-06	6个月	创业板打新限售	16.91	19.79	784	13,257.44	15,515.36	-
301151	冠龙节能	2022-03-30	6个月	创业板打新限售	30.82	21.46	703	21,666.46	15,086.38	-
301160	翔楼新材	2022-05-25	6个月	创业板打新限售	31.56	37.66	392	12,371.52	14,762.72	-
301117	佳缘科技	2022-01-07	6个月	创业板打新限售	46.80	54.44	262	12,261.60	14,263.28	-
301212	联盛化学	2022-04-07	6个月	创业板打新限售	29.67	33.28	416	12,342.72	13,844.48	-
301298	东利机械	2022-05-	6个月	创业板打	12.68	20.83	634	8,039.12	13,206.2	-

		27		新限售					2	
301258	富士莱	2022-03-21	6个月	创业板打新限售	48.30	41.68	295	14,248.50	12,295.60	-
301259	艾布鲁	2022-04-18	6个月	创业板打新限售	18.39	24.94	483	8,882.37	12,046.02	-
301097	天益医疗	2022-03-25	6个月	创业板打新限售	52.37	47.83	249	13,040.13	11,909.67	-
301116	益客食品	2022-01-10	6个月	创业板打新限售	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-
301220	亚香股份	2022-06-15	6个月	创业板打新限售	35.98	39.15	285	10,254.30	11,157.75	-
301137	哈焊华通	2022-03-14	6个月	创业板打新限售	15.37	15.99	644	9,898.28	10,297.56	-
301196	唯科科技	2022-01-04	6个月	创业板打新限售	64.08	37.52	271	17,365.68	10,167.92	-
301222	浙江恒威	2022-03-02	6个月	创业板打新限售	33.98	28.96	332	11,281.36	9,614.72	-

301288	清研环境	2022-04-14	6个月	创业板打新限售	19.09	19.98	452	8,628.68	9,030.96	-
301125	腾亚精工	2022-05-27	6个月	创业板打新限售	22.49	27.42	327	7,354.23	8,966.34	-
301163	宏德股份	2022-04-11	6个月	创业板打新限售	26.27	32.33	277	7,276.79	8,955.41	-
301130	西点药业	2022-02-16	6个月	创业板打新限售	22.55	37.70	237	5,344.35	8,934.90	-
301135	瑞德智能	2022-04-01	6个月	创业板打新限售	31.98	26.26	338	10,809.24	8,875.88	-
301110	青木股份	2022-03-04	6个月	创业板打新限售	63.10	39.85	202	12,746.20	8,049.70	-
301181	标榜股份	2022-02-11	6个月	创业板打新限售	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63	-
301158	德石股份	2022-01-07	6个月	创业板打新限售	15.64	20.38	379	5,927.56	7,724.02	-
301228	实朴检测	2022-01-	6个月	创业板打	20.08	20.34	373	7,489.84	7,586.82	-

		21		新限售						
301279	金道科技	2022-04-06	6个月	创业板打新限售	31.20	22.81	296	9,235.20	6,751.76	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
127064	杭氧转债	2022-05-19	1-6个月（含）	新债未上市	100.00	100.02	1,465	146,500.00	146,527.61	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期。

3、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。

4、创业板新股中科环保（证券代码：301175）于2022年07月08日起上市流通，本基金获配的股数中6,370股根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》于上市后进入限售期，可流通日为2023年01月09日。

5、创业板新股元道通信（证券代码：301139）于2022年07月08日起上市流通，本基金获配的股数中566股根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》于上市后进入限售期，可流通日为2023年01月09日。

6、创业板新股普瑞眼科（证券代码：301239）于2022年07月05日起上市流通，本基金获配的股数中575股根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》于上市后进入限售期，可流通日为2023年01月05日。

7、创业板新股盛帮股份（证券代码：301233）于2022年07月06日起上市流通，本基金获配的股数中158股根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》于上市后进入限售期，可流通日为2023年01月06日。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002670	国盛金控	2022-06-01	未刊登重要事项（未如期刊登临时公告）	9.60	2022-07-14	9.99	438,800	4,370,058.49	4,212,480.00	-

注：本基金截至2022年06月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2022年06月30日，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2022年06月30日，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期 日	期末估值 单价	数量（单 位：股）	期末估值 总额
1	000009	中国宝安	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	13.49	103,300	1,393,51 7.00
2	000012	南玻A	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	7.42	54,800	406,616.0 0
3	000021	深科技	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	11.64	37,400	435,336.0 0
4	000027	深圳能源	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	6.41	138,900	890,349.0 0
5	000031	大悦城	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	4.00	93,300	373,200.0 0
6	000039	中集集团	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	13.85	89,600	1,240,96 0.00
7	000050	深天马A	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	9.97	64,500	643,065.0 0
8	000060	中金岭南	2022年07 月06日-2 022年07	4.46	137,100	611,466.0 0

			月14日			
9	000062	深圳华强	2022年07月14日-2022年07月14日	12.70	10,300	130,810.00
10	000089	深圳机场	2022年07月06日-2022年07月14日	7.72	53,500	413,020.00
11	000156	华数传媒	2022年07月06日-2022年07月14日	7.97	48,500	386,545.00
12	000158	常山北明	2022年07月06日-2022年07月14日	6.00	81,600	489,600.00
13	000400	许继电气	2022年07月06日-2022年07月14日	19.20	51,400	986,880.00
14	000401	冀东水泥	2022年07月06日-2022年07月14日	10.52	55,600	584,912.00
15	000402	金融街	2022年07月06日-2022年07月12日	5.95	47,700	283,815.00
16	000488	晨鸣纸业	2022年07月06日-2022年07月14日	5.64	89,500	504,780.00
17	000519	中兵红箭	2022年07	29.15	33,400	973,610.00

			月06日-2 022年07 月12日			0
18	000528	柳工	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	6.51	71,200	463,512.0 0
19	000537	广宇发展	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	12.99	40,700	528,693.0 0
20	000547	航天发展	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	11.94	65,800	785,652.0 0
21	000559	万向钱潮	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	5.94	52,800	313,632.0 0
22	000563	陕国投A	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	3.12	79,100	246,792.0 0
23	000581	威孚高科	2022年07 月06日-2 022年07 月06日	19.25	10,100	194,425.0 0
24	000598	兴蓉环境	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	5.11	71,700	366,387.0 0
25	000623	吉林敖东	2022年07 月06日-2 022年07	14.76	51,000	752,760.0 0

			月14日			
26	000629	攀钢钒钛	2022年07月06日-2022年07月12日	3.80	172,300	654,740.00
27	000630	铜陵有色	2022年07月06日-2022年07月14日	3.26	386,200	1,259,012.00
28	000636	风华高科	2022年07月06日-2022年07月14日	18.79	59,000	1,108,610.00
29	000656	金科股份	2022年07月06日-2022年07月14日	2.86	273,100	781,066.00
30	000685	中山公用	2022年07月06日-2022年07月14日	7.68	64,600	496,128.00
31	000690	宝新能源	2022年07月06日-2022年07月14日	4.38	159,000	696,420.00
32	000709	河钢股份	2022年07月06日-2022年07月14日	2.26	310,400	701,504.00
33	000717	韶钢松山	2022年07月06日-2022年07月14日	3.50	88,400	309,400.00
34	000718	苏宁环球	2022年07	3.68	79,400	292,192.0

			月06日-2 022年07 月14日			0
35	000728	国元证券	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	6.22	104,900	652,478.0 0
36	000729	燕京啤酒	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	9.66	56,400	544,824.0 0
37	000738	航发控制	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	28.10	26,200	736,220.0 0
38	000739	普洛药业	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	20.64	42,900	885,456.0 0
39	000778	新兴铸管	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	4.82	125,400	604,428.0 0
40	000783	长江证券	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	5.93	155,100	919,743.0 0
41	000807	云铝股份	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	9.88	126,500	1,249,82 0.00
42	000825	太钢不锈	2022年07 月06日-2 022年07	5.45	91,100	496,495.0 0

			月12日			
43	000830	鲁西化工	2022年07月06日-2022年07月14日	17.29	60,300	1,042,587.00
44	000831	五矿稀土	2022年07月06日-2022年07月13日	31.25	42,900	1,340,625.00
45	000878	云南铜业	2022年07月06日-2022年07月14日	11.39	86,900	989,791.00
46	000883	湖北能源	2022年07月06日-2022年07月12日	5.11	79,000	403,690.00
47	000887	中鼎股份	2022年07月06日-2022年07月14日	18.24	57,600	1,050,624.00
48	000898	鞍钢股份	2022年07月06日-2022年07月14日	3.22	125,500	404,110.00
49	000930	中粮科技	2022年07月06日-2022年07月14日	9.04	59,500	537,880.00
50	000932	华菱钢铁	2022年07月06日-2022年07月14日	5.09	217,000	1,104,530.00
51	000937	冀中能源	2022年07	7.46	73,300	546,818.0

			月06日-2 022年07 月14日			0
52	000959	首钢股份	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	4.76	62,500	297,500.0 0
53	000960	锡业股份	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	16.77	52,300	877,071.0 0
54	000961	中南建设	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	3.05	140,000	427,000.0 0
55	000967	盈峰环境	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	5.06	66,500	336,490.0 0
56	000970	中科三环	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	18.78	71,000	1,333,38 0.00
57	000975	银泰黄金	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	9.74	87,300	850,302.0 0
58	000983	山西焦煤	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	13.39	149,200	1,997,78 8.00
59	000987	越秀金控	2022年07 月06日-2 022年07	7.03	109,810	771,964.3 0

			月14日			
60	000988	华工科技	2022年07月06日-2022年07月14日	23.17	73,400	1,700,678.00
61	000990	诚志股份	2022年07月06日-2022年07月14日	10.95	45,700	500,415.00
62	000997	新大陆	2022年07月06日-2022年07月14日	13.21	51,300	677,673.00
63	000998	隆平高科	2022年07月06日-2022年07月14日	16.66	55,400	922,964.00
64	000999	华润三九	2022年07月12日-2022年07月12日	45.00	10,100	454,500.00
65	001914	招商积余	2022年07月12日-2022年07月14日	17.97	23,600	424,092.00
66	002002	鸿达兴业	2022年07月06日-2022年07月14日	3.71	182,500	677,075.00
67	002004	华邦健康	2022年07月06日-2022年07月14日	5.58	84,200	469,836.00
68	002010	传化智联	2022年07	6.43	61,500	395,445.0

			月06日-2 022年07 月14日			0
69	002019	亿帆医药	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	13.98	29,600	413,808.0 0
70	002028	思源电气	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	35.66	44,500	1,586,87 0.00
71	002030	达安基因	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	17.19	39,200	673,848.0 0
72	002048	宁波华翔	2022年07 月12日-2 022年07 月14日	16.02	28,600	458,172.0 0
73	002056	横店东磁	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	26.62	48,300	1,285,74 6.00
74	002065	东华软件	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	6.32	89,900	568,168.0 0
75	002078	太阳纸业	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	12.31	117,800	1,450,11 8.00
76	002081	金螳螂	2022年07 月06日-2 022年07	5.08	70,000	355,600.0 0

			月14日			
77	002092	中泰化学	2022年07月06日-2022年07月14日	7.76	150,500	1,167,880.00
78	002110	三钢闽光	2022年07月06日-2022年07月14日	6.09	64,100	390,369.00
79	002124	天邦食品	2022年07月06日-2022年07月14日	6.72	82,300	553,056.00
80	002127	南极电商	2022年07月06日-2022年07月14日	5.34	143,400	765,756.00
81	002128	电投能源	2022年07月06日-2022年07月12日	14.32	30,800	441,056.00
82	002131	利欧股份	2022年07月06日-2022年07月14日	1.94	491,600	953,704.00
83	002138	顺络电子	2022年07月06日-2022年07月14日	27.25	47,100	1,283,475.00
84	002146	荣盛发展	2022年07月06日-2022年07月14日	3.03	113,700	344,511.00
85	002152	广电运通	2022年07	9.27	49,600	459,792.00

			月06日-2 022年07 月12日			0
86	002153	石基信息	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	15.87	40,700	645,909.0 0
87	002155	湖南黄金	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	12.14	61,300	744,182.0 0
88	002156	通富微电	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	15.40	48,800	751,520.0 0
89	002174	游族网络	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	9.77	53,500	522,695.0 0
90	002180	纳思达	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	50.62	28,300	1,432,54 6.00
91	002183	怡亚通	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	7.21	132,800	957,488.0 0
92	002185	华天科技	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	9.38	117,900	1,105,90 2.00
93	002191	劲嘉股份	2022年07 月06日-2 022年07	10.72	75,100	805,072.0 0

			月14日			
94	002195	二三四五	2022年07月06日-2022年07月14日	2.25	418,400	941,400.00
95	002203	海亮股份	2022年07月06日-2022年07月14日	11.55	85,800	990,990.00
96	002221	东华能源	2022年07月06日-2022年07月14日	9.31	84,300	784,833.00
97	002223	鱼跃医疗	2022年07月06日-2022年07月12日	25.66	24,000	615,840.00
98	002233	塔牌集团	2022年07月06日-2022年07月14日	8.85	43,600	385,860.00
99	002240	盛新锂能	2022年07月06日-2022年07月14日	60.36	42,900	2,589,444.00
100	002242	九阳股份	2022年07月14日-2022年07月14日	18.36	10,100	185,436.00
101	002244	滨江集团	2022年07月06日-2022年07月14日	8.65	65,100	563,115.00
102	002249	大洋电机	2022年07	6.14	99,100	608,474.0

			月06日-2 022年07 月14日			0
103	002250	联化科技	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	16.37	29,500	482,915.0 0
104	002266	浙富控股	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	4.79	112,500	538,875.0 0
105	002273	水晶光电	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	12.11	101,500	1,229,16 5.00
106	002281	光迅科技	2022年07 月12日-2 022年07 月14日	17.58	22,600	397,308.0 0
107	002294	信立泰	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	28.10	22,300	626,630.0 0
108	002299	圣农发展	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	19.18	29,800	571,564.0 0
109	002326	永太科技	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	32.93	44,700	1,471,97 1.00
110	002353	杰瑞股份	2022年07 月06日-2 022年07	40.30	41,900	1,688,57 0.00

			月14日			
111	002368	太极股份	2022年07月12日-2022年07月12日	19.21	10,400	199,784.00
112	002372	伟星新材	2022年07月06日-2022年07月14日	24.04	46,400	1,115,456.00
113	002373	千方科技	2022年07月06日-2022年07月14日	11.12	80,800	898,496.00
114	002382	蓝帆医疗	2022年07月06日-2022年07月13日	9.55	51,500	491,825.00
115	002384	东山精密	2022年07月06日-2022年07月14日	22.93	99,800	2,288,414.00
116	002385	大北农	2022年07月06日-2022年07月12日	7.81	132,700	1,036,387.00
117	002387	维信诺	2022年07月06日-2022年07月14日	6.72	50,500	339,360.00
118	002390	信邦制药	2022年07月06日-2022年07月14日	6.91	86,400	597,024.00
119	002396	星网锐捷	2022年07	22.64	12,000	271,680.0

			月12日-2 022年07 月12日			0
120	002407	多氟多	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	48.91	30,600	1,496,64 6.00
121	002408	齐翔腾达	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	8.11	124,600	1,010,50 6.00
122	002416	爱施德	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	9.30	29,700	276,210.0 0
123	002422	科伦药业	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	18.70	50,100	936,870.0 0
124	002429	兆驰股份	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	3.84	118,500	455,040.0 0
125	002430	杭氧股份	2022年07 月12日-2 022年07 月12日	31.26	10,100	315,726.0 0
126	002434	万里扬	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	8.55	47,800	408,690.0 0
127	002439	启明星辰	2022年07 月06日-2 022年07	19.93	41,400	825,102.0 0

			月14日			
128	002444	巨星科技	2022年07月06日-2022年07月12日	18.84	27,400	516,216.00
129	002465	海格通信	2022年07月06日-2022年07月12日	9.09	73,800	670,842.00
130	002468	申通快递	2022年07月06日-2022年07月12日	11.92	30,600	364,752.00
131	002497	雅化集团	2022年07月06日-2022年07月14日	32.65	60,300	1,968,795.00
132	002500	山西证券	2022年07月06日-2022年07月12日	5.74	86,300	495,362.00
133	002505	鹏都农牧	2022年07月06日-2022年07月14日	3.39	167,000	566,130.00
134	002506	协鑫集成	2022年07月06日-2022年07月14日	3.72	221,900	825,468.00
135	002507	涪陵榨菜	2022年07月06日-2022年07月12日	34.52	24,800	856,096.00
136	002508	老板电器	2022年07	36.03	12,100	435,963.00

			月12日-2 022年07 月12日			0
137	002511	中顺洁柔	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	12.52	57,500	719,900.0 0
138	002563	森马服饰	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	5.92	32,300	191,216.0 0
139	002572	索菲亚	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	27.50	25,500	701,250.0 0
140	002595	豪迈科技	2022年07 月12日-2 022年07 月12日	22.34	10,200	227,868.0 0
141	002603	以岭药业	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	24.30	60,900	1,479,87 0.00
142	002624	完美世界	2022年07 月06日-2 022年07 月13日	14.37	99,300	1,426,94 1.00
143	002625	光启技术	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	17.27	67,600	1,167,45 2.00
144	002673	西部证券	2022年07 月06日-2 022年07	6.54	106,300	695,202.0 0

			月12日			
145	002683	广东宏大	2022年07月06日-2022年07月14日	27.83	38,200	1,063,106.00
146	002701	奥瑞金	2022年07月06日-2022年07月12日	5.20	72,100	374,920.00
147	002739	万达电影	2022年07月06日-2022年07月14日	13.65	58,300	795,795.00
148	002745	木林森	2022年07月06日-2022年07月14日	9.77	46,700	456,259.00
149	002797	第一创业	2022年07月06日-2022年07月12日	6.41	134,100	859,581.00
150	002926	华西证券	2022年07月06日-2022年07月12日	7.84	63,000	493,920.00
151	002939	长城证券	2022年07月06日-2022年07月14日	10.16	67,900	689,864.00
152	002958	青农商行	2022年07月06日-2022年07月12日	3.32	155,600	516,592.00
153	003035	南网能源	2022年07	6.35	80,300	509,905.00

			月06日-2 022年07 月14日			0
154	300001	特锐德	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	17.31	32,100	555,651.0 0
155	300009	安科生物	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	10.11	51,200	517,632.0 0
156	300012	华测检测	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	23.21	74,800	1,736,10 8.00
157	300017	网宿科技	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	5.36	104,500	560,120.0 0
158	300024	机器人	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	10.08	90,500	912,240.0 0
159	300026	红日药业	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	7.70	125,700	967,890.0 0
160	300037	新宙邦	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	52.56	20,700	1,087,99 2.00
161	300058	蓝色光标	2022年07 月06日-2 022年07	6.53	182,100	1,189,11 3.00

			月14日			
162	300070	碧水源	2022年07月06日-2022年07月14日	5.21	152,000	791,920.00
163	300072	海新能科	2022年07月06日-2022年07月14日	5.06	87,100	440,726.00
164	300073	当升科技	2022年07月06日-2022年07月12日	90.34	14,100	1,273,794.00
165	300088	长信科技	2022年07月06日-2022年07月14日	7.42	136,600	1,013,572.00
166	300115	长盈精密	2022年07月06日-2022年07月14日	10.31	61,200	630,972.00
167	300136	信维通信	2022年07月06日-2022年07月14日	16.85	54,800	923,380.00
168	300144	宋城演艺	2022年07月06日-2022年07月14日	15.35	70,000	1,074,500.00
169	300146	汤臣倍健	2022年07月06日-2022年07月14日	21.65	42,100	911,465.00
170	300166	东方国信	2022年07	9.22	67,200	619,584.0

			月06日-2 022年07 月14日			0
171	300168	万达信息	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	9.44	47,600	449,344.0 0
172	300182	捷成股份	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	5.50	150,200	826,100.0 0
173	300212	易华录	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	17.40	15,900	276,660.0 0
174	300244	迪安诊断	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	31.10	19,800	615,780.0 0
175	300251	光线传媒	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	9.47	52,300	495,281.0 0
176	300253	卫宁健康	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	8.78	72,800	639,184.0 0
177	300257	开山股份	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	14.96	15,800	236,368.0 0
178	300285	国瓷材料	2022年07 月06日-2 022年07	35.92	35,800	1,285,93 6.00

			月14日			
179	300296	利亚德	2022年07月06日-2022年07月12日	7.30	81,500	594,950.00
180	300308	中际旭创	2022年07月06日-2022年07月14日	31.05	21,300	661,365.00
181	300357	我武生物	2022年07月06日-2022年07月14日	52.03	13,700	712,811.00
182	300363	博腾股份	2022年07月06日-2022年07月12日	77.99	13,000	1,013,870.00
183	300383	光环新网	2022年07月06日-2022年07月14日	10.42	91,800	956,556.00
184	300418	昆仑万维	2022年07月06日-2022年07月14日	16.00	42,600	681,600.00
185	300463	迈克生物	2022年07月06日-2022年07月12日	20.49	17,100	350,379.00
186	300474	景嘉微	2022年07月06日-2022年07月14日	68.39	12,000	820,680.00
187	300482	万孚生物	2022年07	40.71	11,800	480,378.00

			月06日-2 022年07 月14日			0
188	300558	贝达药业	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	60.80	11,000	668,800.0 0
189	300618	寒锐钴业	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	57.92	8,600	498,112.0 0
190	300630	普利制药	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	35.15	10,400	365,560.0 0
191	300676	华大基因	2022年07 月06日-2 022年07 月13日	71.70	15,700	1,125,69 0.00
192	300677	英科医疗	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	25.36	20,600	522,416.0 0
193	300699	光威复材	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	58.87	13,800	812,406.0 0
194	600006	东风汽车	2022年07 月06日-2 022年07 月13日	7.55	58,300	440,165.0 0
195	600008	首创环保	2022年07 月06日-2 022年07	2.90	230,700	669,030.0 0

			月14日			
196	600021	上海电力	2022年07月06日-2022年07月14日	10.25	76,400	783,100.00
197	600022	山东钢铁	2022年07月06日-2022年07月14日	1.74	286,800	499,032.00
198	600026	中远海能	2022年07月06日-2022年07月14日	10.33	101,400	1,047,462.00
199	600027	华电国际	2022年07月06日-2022年07月14日	3.93	170,500	670,065.00
200	600037	歌华有线	2022年07月06日-2022年07月14日	9.39	50,900	477,951.00
201	600039	四川路桥	2022年07月06日-2022年07月12日	10.53	76,900	809,757.00
202	600056	中国医药	2022年07月06日-2022年07月13日	14.82	55,820	827,252.40
203	600060	海信视像	2022年07月06日-2022年07月14日	12.50	56,400	705,000.00
204	600062	华润双鹤	2022年07	25.66	21,900	561,954.00

			月12日-2 022年07 月13日			0
205	600064	南京高科	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	11.00	45,200	497,200.0 0
206	600066	宇通客车	2022年07 月06日-2 022年07 月13日	8.65	96,900	838,185.0 0
207	600096	云天化	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	31.48	91,500	2,880,42 0.00
208	600109	国金证券	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	9.00	89,300	803,700.0 0
209	600118	中国卫星	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	20.08	23,600	473,888.0 0
210	600120	浙江东方	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	4.01	126,800	508,468.0 0
211	600126	杭钢股份	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	5.12	53,900	275,968.0 0
212	600131	国网信通	2022年07 月12日-2 022年07	13.45	12,200	164,090.0 0

			月12日			
213	600141	兴发集团	2022年07月06日-2022年07月14日	43.99	41,300	1,816,787.00
214	600143	金发科技	2022年07月06日-2022年07月14日	9.52	131,400	1,250,928.00
215	600153	建发股份	2022年07月06日-2022年07月14日	13.07	77,800	1,016,846.00
216	600155	华创阳安	2022年07月06日-2022年07月12日	8.48	48,700	412,976.00
217	600157	永泰能源	2022年07月06日-2022年07月14日	1.59	1,622,300	2,579,457.00
218	600160	巨化股份	2022年07月06日-2022年07月14日	13.15	70,600	928,390.00
219	600166	福田汽车	2022年07月06日-2022年07月14日	2.83	336,300	951,729.00
220	600167	联美控股	2022年07月06日-2022年07月14日	7.49	47,800	358,022.00
221	600170	上海建工	2022年07	3.03	390,100	1,182,00

			月06日-2 022年07 月14日			3.00
222	600171	上海贝岭	2022年07 月06日-2 022年07 月13日	25.03	41,500	1,038,74 5.00
223	600177	雅戈尔	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	6.63	111,100	736,593.0 0
224	600195	中牧股份	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	12.26	24,400	299,144.0 0
225	600201	生物股份	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	9.16	59,700	546,852.0 0
226	600208	新湖中宝	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	2.76	313,900	866,364.0 0
227	600216	浙江医药	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	13.65	27,000	368,550.0 0
228	600233	圆通速递	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	20.39	54,900	1,119,41 1.00
229	600236	桂冠电力	2022年07 月06日-2 022年07	6.09	123,700	753,333.0 0

			月14日			
230	600256	广汇能源	2022年07月06日-2022年07月14日	10.54	240,500	2,534,870.00
231	600258	首旅酒店	2022年07月06日-2022年07月14日	24.80	40,700	1,009,360.00
232	600271	航天信息	2022年07月06日-2022年07月12日	10.94	44,400	485,736.00
233	600282	南钢股份	2022年07月06日-2022年07月12日	3.15	123,300	388,395.00
234	600297	广汇汽车	2022年07月06日-2022年07月14日	2.61	289,200	754,812.00
235	600298	安琪酵母	2022年07月06日-2022年07月06日	48.75	10,100	492,375.00
236	600299	安迪苏	2022年07月12日-2022年07月12日	9.58	10,300	98,674.00
237	600307	酒钢宏兴	2022年07月06日-2022年07月14日	1.94	163,700	317,578.00
238	600316	洪都航空	2022年07	30.24	11,000	332,640.00

			月12日-2 022年07 月12日			0
239	600325	华发股份	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	7.57	67,600	511,732.0 0
240	600339	中油工程	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	2.89	122,300	353,447.0 0
241	600348	华阳股份	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	15.46	87,700	1,355,84 2.00
242	600350	山东高速	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	5.25	24,800	130,200.0 0
243	600369	西南证券	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	3.97	132,800	527,216.0 0
244	600372	中航电子	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	19.39	30,800	597,212.0 0
245	600373	中文传媒	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	9.99	49,300	492,507.0 0
246	600376	首开股份	2022年07 月06日-2 022年07	4.91	67,400	330,934.0 0

			月14日			
247	600377	宁沪高速	2022年07月06日-2022年07月06日	8.57	10,000	85,700.00
248	600380	健康元	2022年07月06日-2022年07月14日	12.35	83,200	1,027,520.00
249	600390	五矿资本	2022年07月06日-2022年07月14日	4.89	117,800	576,042.00
250	600392	盛和资源	2022年07月06日-2022年07月14日	22.60	73,300	1,656,580.00
251	600398	海澜之家	2022年07月06日-2022年07月14日	4.75	119,400	567,150.00
252	600409	三友化工	2022年07月06日-2022年07月14日	8.19	90,300	739,557.00
253	600415	小商品城	2022年07月06日-2022年07月14日	5.57	143,800	800,966.00
254	600418	江淮汽车	2022年07月06日-2022年07月14日	17.16	127,400	2,186,184.00
255	600435	北方导航	2022年07	8.62	65,100	561,162.0

			月06日-2 022年07 月14日			0
256	600446	金证股份	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	10.38	42,500	441,150.0 0
257	600482	中国动力	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	15.71	56,400	886,044.0 0
258	600487	亨通光电	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	14.54	75,500	1,097,77 0.00
259	600497	驰宏锌锗	2022年07 月06日-2 022年07 月13日	5.19	260,300	1,350,95 7.00
260	600498	烽火通信	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	14.48	28,500	412,680.0 0
261	600499	科达制造	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	20.64	96,400	1,989,69 6.00
262	600500	中化国际	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	6.65	72,200	480,130.0 0
263	600507	方大特钢	2022年07 月06日-2 022年07	6.99	61,000	426,390.0 0

			月14日			
264	600511	国药股份	2022年07月14日-2022年07月14日	26.78	12,400	332,072.00
265	600516	方大炭素	2022年07月06日-2022年07月14日	7.60	166,700	1,266,920.00
266	600517	国网英大	2022年07月06日-2022年07月14日	5.19	89,800	466,062.00
267	600521	华海药业	2022年07月06日-2022年07月12日	22.70	35,800	812,660.00
268	600522	中天科技	2022年07月06日-2022年07月14日	23.10	142,800	3,298,680.00
269	600528	中铁工业	2022年07月06日-2022年07月14日	8.05	69,700	561,085.00
270	600529	山东药玻	2022年07月12日-2022年07月12日	27.95	12,200	340,990.00
271	600535	天士力	2022年07月06日-2022年07月14日	10.51	47,100	495,021.00
272	600536	中国软件	2022年07	40.59	10,100	409,959.00

			月12日-2 022年07 月12日			0
273	600546	山煤国际	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	19.46	72,300	1,406,95 8.00
274	600549	厦门钨业	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	21.62	58,000	1,253,96 0.00
275	600566	济川药业	2022年07 月14日-2 022年07 月14日	27.16	11,700	317,772.0 0
276	600567	山鹰国际	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	2.77	236,300	654,551.0 0
277	600572	康恩贝	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	4.43	97,700	432,811.0 0
278	600580	卧龙电驱	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	14.42	48,000	692,160.0 0
279	600582	天地科技	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	4.78	64,600	308,788.0 0
280	600597	光明乳业	2022年07 月06日-2 022年07	12.63	27,500	347,325.0 0

			月12日			
281	600598	北大荒	2022年07月06日-2022年07月12日	14.76	28,300	417,708.00
282	600623	华谊集团	2022年07月06日-2022年07月12日	8.30	30,100	249,830.00
283	600637	东方明珠	2022年07月06日-2022年07月14日	7.15	107,300	767,195.00
284	600642	申能股份	2022年07月06日-2022年07月12日	5.68	98,200	557,776.00
285	600663	陆家嘴	2022年07月06日-2022年07月14日	10.36	46,000	476,560.00
286	600667	太极实业	2022年07月06日-2022年07月14日	7.38	77,200	569,736.00
287	600673	东阳光	2022年07月06日-2022年07月14日	8.99	110,000	988,900.00
288	600699	均胜电子	2022年07月06日-2022年07月14日	15.71	65,600	1,030,576.00
289	600704	物产中大	2022年07	5.13	163,200	837,216.0

			月06日-2 022年07 月14日			0
290	600705	中航产融	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	3.46	280,100	969,146.0 0
291	600707	彩虹股份	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	4.68	104,800	490,464.0 0
292	600717	天津港	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	4.01	105,600	423,456.0 0
293	600718	东软集团	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	11.51	34,700	399,397.0 0
294	600728	佳都科技	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	6.46	73,400	474,164.0 0
295	600737	中粮糖业	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	7.52	56,700	426,384.0 0
296	600739	辽宁成大	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	14.58	56,000	816,480.0 0
297	600755	厦门国贸	2022年07 月06日-2 022年07	7.50	71,100	533,250.0 0

			月14日			
298	600765	中航重机	2022年07月06日-2022年07月12日	32.18	35,300	1,135,954.00
299	600782	新钢股份	2022年07月06日-2022年07月12日	5.04	76,500	385,560.00
300	600787	中储股份	2022年07月06日-2022年07月14日	5.69	63,900	363,591.00
301	600801	华新水泥	2022年07月06日-2022年07月12日	19.51	27,100	528,721.00
302	600808	马钢股份	2022年07月06日-2022年07月14日	3.79	176,400	668,556.00
303	600811	东方集团	2022年07月06日-2022年07月14日	2.83	134,100	379,503.00
304	600820	隧道股份	2022年07月06日-2022年07月14日	6.12	160,700	983,484.00
305	600827	百联股份	2022年07月06日-2022年07月14日	13.21	56,500	746,365.00
306	600835	上海机电	2022年07	13.73	10,600	145,538.0

			月14日-2 022年07 月14日			0
307	600839	四川长虹	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	2.88	193,500	557,280.0 0
308	600848	上海临港	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	13.56	69,100	936,996.0 0
309	600859	王府井	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	25.98	48,400	1,257,43 2.00
310	600862	中航高科	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	28.10	33,400	938,540.0 0
311	600863	内蒙华电	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	3.65	170,800	623,420.0 0
312	600867	通化东宝	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	10.34	56,100	580,074.0 0
313	600871	石化油服	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	1.89	296,800	560,952.0 0
314	600875	东方电气	2022年07 月06日-2 022年07	16.45	81,000	1,332,45 0.00

			月14日			
315	600879	航天电子	2022年07月06日-2022年07月12日	6.49	86,900	563,981.00
316	600885	宏发股份	2022年07月06日-2022年07月12日	41.85	33,320	1,394,442.00
317	600895	张江高科	2022年07月06日-2022年07月14日	12.45	56,400	702,180.00
318	600901	江苏租赁	2022年07月06日-2022年07月14日	5.13	62,300	319,599.00
319	600909	华安证券	2022年07月06日-2022年07月12日	4.55	112,700	512,785.00
320	600928	西安银行	2022年07月06日-2022年07月12日	3.67	53,200	195,244.00
321	600959	江苏有线	2022年07月06日-2022年07月14日	3.26	157,100	512,146.00
322	600967	内蒙一机	2022年07月06日-2022年07月14日	9.12	44,500	405,840.00
323	600968	海油发展	2022年07	2.58	148,100	382,098.00

			月06日-2 022年07 月14日			0
324	600970	中材国际	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	9.69	59,200	573,648.0 0
325	600985	淮北矿业	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	14.56	51,800	754,208.0 0
326	600988	赤峰黄金	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	15.95	97,200	1,550,34 0.00
327	600998	九州通	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	11.91	47,700	568,107.0 0
328	601000	唐山港	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	2.58	154,900	399,642.0 0
329	601003	柳钢股份	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	4.05	20,300	82,215.00
330	601005	重庆钢铁	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	1.91	350,700	669,837.0 0
331	601016	节能风电	2022年07 月06日-2 022年07	4.80	219,500	1,053,60 0.00

			月12日			
332	601058	赛轮轮胎	2022年07月06日-2022年07月14日	11.27	166,200	1,873,074.00
333	601077	渝农商行	2022年07月06日-2022年07月12日	3.70	247,700	916,490.00
334	601098	中南传媒	2022年07月06日-2022年07月12日	9.44	28,600	269,984.00
335	601106	中国一重	2022年07月06日-2022年07月14日	3.07	200,200	614,614.00
336	601108	财通证券	2022年07月06日-2022年07月12日	7.87	130,000	1,023,100.00
337	601118	海南橡胶	2022年07月06日-2022年07月14日	4.78	83,700	400,086.00
338	601128	常熟银行	2022年07月06日-2022年07月12日	7.64	109,600	837,344.00
339	601139	深圳燃气	2022年07月06日-2022年07月14日	6.94	41,700	289,398.00
340	601162	天风证券	2022年07	3.18	291,500	926,970.00

			月06日-2 022年07 月14日			0
341	601168	西部矿业	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	11.83	99,800	1,180,63 4.00
342	601179	中国西电	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	4.68	107,300	502,164.0 0
343	601198	东兴证券	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	8.90	64,700	575,830.0 0
344	601228	广州港	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	3.67	90,400	331,768.0 0
345	601298	青岛港	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	5.47	27,900	152,613.0 0
346	601333	广深铁路	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	2.18	135,500	295,390.0 0
347	601555	东吴证券	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	6.93	160,200	1,110,18 6.00
348	601577	长沙银行	2022年07 月06日-2 022年07	7.93	80,400	637,572.0 0

			月12日			
349	601598	中国外运	2022年07月06日-2022年07月14日	3.88	82,300	319,324.00
350	601607	上海医药	2022年07月06日-2022年07月12日	18.08	44,400	802,752.00
351	601608	中信重工	2022年07月06日-2022年07月12日	3.79	69,200	262,268.00
352	601611	中国核建	2022年07月06日-2022年07月12日	8.39	31,700	265,963.00
353	601615	明阳智能	2022年07月06日-2022年07月14日	33.80	122,700	4,147,260.00
354	601636	旗滨集团	2022年07月06日-2022年07月14日	12.75	84,400	1,076,100.00
355	601696	中银证券	2022年07月06日-2022年07月14日	13.30	121,700	1,618,610.00
356	601699	潞安环能	2022年07月06日-2022年07月14日	14.62	62,600	915,212.00
357	601717	郑煤机	2022年07	14.41	67,200	968,352.0

			月06日-2 022年07 月14日			0
358	601718	际华集团	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	3.10	137,700	426,870.0 0
359	601828	美凯龙	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	6.06	39,200	237,552.0 0
360	601860	紫金银行	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	2.87	117,000	335,790.0 0
361	601866	中远海发	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	3.00	289,500	868,500.0 0
362	601872	招商轮船	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	5.76	236,700	1,363,39 2.00
363	601880	辽港股份	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	1.70	295,800	502,860.0 0
364	601928	凤凰传媒	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	7.15	30,500	218,075.0 0
365	601958	金钼股份	2022年07 月06日-2 022年07	8.84	50,600	447,304.0 0

			月14日			
366	601969	海南矿业	2022年07月06日-2022年07月12日	8.59	24,400	209,596.00
367	601990	南京证券	2022年07月06日-2022年07月12日	8.34	88,400	737,256.00
368	601991	大唐发电	2022年07月06日-2022年07月14日	2.43	129,500	314,685.00
369	601992	金隅集团	2022年07月06日-2022年07月14日	2.77	218,200	604,414.00
370	601997	贵阳银行	2022年07月06日-2022年07月12日	5.81	117,000	679,770.00
371	603000	人民网	2022年07月06日-2022年07月14日	11.20	40,400	452,480.00
372	603077	和邦生物	2022年07月06日-2022年07月14日	4.26	338,700	1,442,862.00
373	603156	养元饮品	2022年07月06日-2022年07月12日	22.72	20,200	458,944.00
374	603218	日月股份	2022年07	25.40	28,300	718,820.00

			月12日-2 022年07 月14日			0
375	603225	新凤鸣	2022年07 月06日-2 022年07 月14日	11.54	55,700	642,778.0 0
376	603233	大参林	2022年07 月14日-2 022年07 月14日	31.30	12,500	391,250.0 0
377	603456	九洲药业	2022年07 月06日-2 022年07 月06日	51.70	10,100	522,170.0 0
378	603568	伟明环保	2022年07 月12日-2 022年07 月12日	33.37	10,000	333,700.0 0
379	603638	艾迪精密	2022年07 月14日-2 022年07 月14日	20.50	11,100	227,550.0 0
380	603858	步长制药	2022年07 月06日-2 022年07 月12日	19.71	22,800	449,388.0 0
381	603866	桃李面包	2022年07 月06日-2 022年07 月13日	16.55	38,800	642,140.0 0
382	603885	吉祥航空	2022年07 月06日-2 022年07	17.99	42,900	771,771.0 0

			月14日			
383	603939	益丰药房	2022年07月14日-2022年07月14日	52.83	11,800	623,394.00
384	688006	杭可科技	2022年07月06日-2022年07月14日	70.06	7,800	546,468.00
385	688009	中国通号	2022年07月06日-2022年07月12日	4.53	103,300	467,949.00
386	688029	南微医学	2022年07月06日-2022年07月14日	87.20	4,000	348,800.00
387	688088	虹软科技	2022年07月06日-2022年07月14日	31.59	14,600	461,214.00
388	688099	晶晨股份	2022年07月06日-2022年07月12日	101.00	9,800	989,800.00
389	688180	君实生物	2022年07月06日-2022年07月06日	75.34	7,000	527,380.00
390	688185	康希诺	2022年07月06日-2022年07月12日	199.08	2,700	537,516.00
391	688188	柏楚电子	2022年07	220.04	1,100	242,044.00

			月12日-2022年07月12日			0
392	688256	寒武纪	2022年07月06日-2022年07月14日	64.70	10,400	672,880.00
393	688390	固德威	2022年07月06日-2022年07月12日	313.01	2,400	751,224.00
394	688521	芯原股份	2022年07月06日-2022年07月12日	49.40	9,900	489,060.00
395	688819	天能股份	2022年07月06日-2022年07月12日	34.58	5,000	172,900.00
合计					34,415,950	290,334,666.70

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是被动式投资的股票型指数基金，紧密跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似，本基金预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。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，跟踪标的指数，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。但因特殊情况（比如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可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理念，建立了以审计与风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、内控合规部、风险管理部、内审部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在全面风险管理体系的框架下，董事会负责监督检查公司的

合法合规运营、内部控制、风险管理，从而控制公司的整体运营风险。在董事会下设立审计与风险控制委员会，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管理委员会，主要负责拟定公司风险管理战略，经董事会批准后组织实施；组织实施经董事会批准的年度风险预算、风险可容忍度限额及其他量化风险管理工具；根据公司总体风险控制目标，制定各业务和各环节风险控制目标和要求；落实公司就重大风险管理作出的决定或决议；听取并讨论会议议题，就重大风险管理事项形成决议；拟定或批准公司风险管理制度、流程。在业务操作层面风险管理职责主要由内控合规部和风险管理部负责，内控合规部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理提供合规控制标准，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；内控合规部对公司总经理负责，并由督察长分管。风险管理部通过投资交易系统的风控参数设置，保证各投资组合的投资比例合规；参与各投资组合新股申购、一级债申购、银行间交易等场外交易的风险识别与评估，保证各投资组合场外交易的事中合规控制；负责各投资组合投资绩效、大类风险的识别、计量和控制。风险管理部向公司首席风控官进行汇报。内审部对公司内部控制和风险管理的有效性，经营效率和效果等方面开展独立评价活动，向总经理和督察长汇报。

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

6.4.13.2 信用风险

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

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。本基金的活期银行存款和定期存款存放在本基金的托管人国泰君安证券股份有限公司开立于具有基金托管资格的银行的托管账户及其他具有基金托管资格的国有银行和大型股份制银行，并实施不同区间的额度管理，因而与银行存款相关的信用风险不重大。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，违约风险可能性很小；在银行间

同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	146,527.61	202,296.10
未评级	-	-
合计	146,527.61	202,296.10

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自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，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于2022年06月30日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金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6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。本期末，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法律法规的相关要求。

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交易对手管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的管理人定期对组合中债券投资和资产支持证券投资部分面临的利率风险进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	25,995,130.97	-	-	-	25,995,130.97
结算备付金	64,873,396.41	-	-	-	64,873,396.41
存出保证金	13,947,427.16	-	-	-	13,947,427.16
交易性金融资产	-	-	146,527.61	2,343,729,662.38	2,343,876,189.99
应收清算款	-	-	-	18,362.34	18,362.34
应收股利	-	-	-	398,127.82	398,127.82
其他资产	-	-	-	130,104.64	130,104.64
资产总计	104,815,954.54	-	146,527.61	2,344,276,257.18	2,449,238,739.33
负债					
应付清算款	-	-	-	443,160.32	443,160.32
应付管理人报酬	-	-	-	977,321.95	977,321.95
应付托管费	-	-	-	195,464.38	195,464.38
应交税费	-	-	-	3,046.53	3,046.53
其他负债	-	-	-	817,998.14	817,998.14
负债总计	-	-	-	2,436,991.32	2,436,991.32
利率敏感度缺口	104,815,954.54	-	146,527.61	2,341,839,265.86	2,446,801,748.01
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	45,464,854.58	-	-	-	45,464,854.58
结算备付金	116,831,782.44	-	-	1,001.00	116,832,783.44
存出保证金	641,430.76	-	-	24,789,408.00	25,430,838.76
交易性金融资产	-	-	202,296.10	2,190,025,003.29	2,190,227,299.39
应收证券清算款	-	-	-	260,190.17	260,190.17
应收利息	-	-	-	284,867.79	284,867.79
应收股利	-	-	-	539.00	539.00
资产总计	162,938,067.78	-	202,296.10	2,215,361,009.25	2,378,501,373.13
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,304,905.52	1,304,905.52

应付管理人报酬	-	-	-	1,015,836.23	1,015,836.23
应付托管费	-	-	-	203,167.27	203,167.27
应付交易费用	-	-	-	629,042.63	629,042.63
应交税费	-	-	-	189,223.40	189,223.40
其他负债	-	-	-	492,180.91	492,180.91
负债总计	-	-	-	3,834,355.96	3,834,355.96
利率敏感度缺口	162,938,067.78	-	202,296.10	2,211,526,653.29	2,374,667,017.17

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2022年06月30日，本基金持有的交易性债券投资占基金资产净值的比例为0.01%(2021年12月31日：0.01%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2021年12月31日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金原则上采用完全复制法，跟踪中证500指数，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金投资组合，并根据标的指数组成及其权重的变动而进行相应调整。但因特殊情况(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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中，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90%，且不低于非现金基金资产的80%。每个交易日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	2,343,729,662.38	95.79	2,190,025,003.29	92.22
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	2,343,729,662.38	95.79	2,190,025,003.29	92.22

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注6.4.7.3)。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。

6.4.13.4.3.2 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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	业绩比较基准上升5%	123,502,318.23	111,379,378.69
	业绩比较基准下降5%	-123,502,318.23	-111,379,378.69

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具**6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值**

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	2,336,963,551.43	2,184,255,883.87
第二层次	5,485,314.02	4,801,041.35
第三层次	1,427,324.54	1,170,374.17
合计	2,343,876,189.99	2,190,227,299.39

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2022年06月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2021年12月31日：同）。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,343,729,662.38	95.69
	其中：股票	2,343,729,662.38	95.69
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	146,527.61	0.01
	其中：债券	146,527.61	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	90,868,527.38	3.71
8	其他各项资产	14,494,021.96	0.59
9	合计	2,449,238,739.33	100.00

注：本报告期末，本基金参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为 290,334,666.70 元，占基金资产净值的比例为 11.87%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	21,465,061.60	0.88
B	采矿业	103,770,064.80	4.24
C	制造业	1,392,176,598.10	56.90
D	电力、热力、燃气及水生	72,218,963.24	2.95

	产和供应业		
E	建筑业	30,181,113.00	1.23
F	批发和零售业	90,132,773.83	3.68
G	交通运输、仓储和邮政业	62,443,885.60	2.55
H	住宿和餐饮业	4,930,240.00	0.20
I	信息传输、软件和信息技术服务业	173,348,011.39	7.08
J	金融业	206,705,888.04	8.45
K	房地产业	55,239,129.10	2.26
L	租赁和商务服务业	28,321,608.00	1.16
M	科学研究和技术服务业	29,216,617.60	1.19
N	水利、环境和公共设施管理业	17,024,291.00	0.70
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	5,488,590.20	0.22
R	文化、体育和娱乐业	31,292,710.00	1.28
S	综合	17,172,332.00	0.70
	合计	2,341,127,877.50	95.68

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,728,585.30	0.07
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	21,401.16	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	283,446.20	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	19,959.78	0.00
M	科学研究和技术服务业	53,749.33	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	285,022.42	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	209,620.69	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,601,784.88	0.11

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600522	中天科技	970,512	22,418,827.20	0.92
2	601615	明阳智能	597,500	20,195,500.00	0.83
3	600256	广汇能源	1,633,800	17,220,252.00	0.70
4	300769	德方纳米	37,000	15,121,160.00	0.62
5	600096	云天化	456,201	14,361,207.48	0.59
6	300012	华测检测	596,560	13,846,157.60	0.57
7	002497	雅化集团	409,200	13,360,380.00	0.55
8	002407	多氟多	272,000	13,303,520.00	0.54
9	002240	盛新锂能	215,000	12,977,400.00	0.53

10	300390	天华超净	146,200	12,777,880.00	0.52
11	002180	纳思达	251,400	12,725,868.00	0.52
12	600157	永泰能源	7,887,600	12,541,284.00	0.51
13	000009	中国宝安	915,700	12,352,793.00	0.50
14	600885	DR宏发股	293,860	12,298,041.00	0.50
15	600141	兴发集团	276,700	12,172,033.00	0.50
16	300073	当升科技	125,900	11,373,806.00	0.46
17	600392	盛和资源	497,800	11,250,280.00	0.46
18	002384	东山精密	485,717	11,137,490.81	0.46
19	603613	国联股份	123,939	10,980,995.40	0.45
20	002756	永兴材料	72,100	10,974,341.00	0.45
21	600418	江淮汽车	620,300	10,644,348.00	0.44
22	300285	国瓷材料	285,108	10,241,079.36	0.42
23	600765	中航重机	313,640	10,092,935.20	0.41
24	600399	抚顺特钢	560,900	10,040,110.00	0.41
25	600233	圆通速递	488,200	9,954,398.00	0.41
26	601555	东吴证券	1,422,270	9,856,331.10	0.40
27	600563	法拉电子	47,900	9,827,164.00	0.40
28	601058	赛轮轮胎	870,000	9,804,900.00	0.40
29	600487	亨通光电	670,900	9,754,886.00	0.40
30	000983	山西焦煤	727,000	9,734,530.00	0.40
31	300037	新宙邦	184,560	9,700,473.60	0.40
32	600499	科达制造	469,500	9,690,480.00	0.40
33	600732	爱旭股份	289,600	9,562,592.00	0.39
34	603077	和邦生物	2,194,500	9,348,570.00	0.38
35	688180	君实生物	122,800	9,251,752.00	0.38
36	603456	九洲药业	177,700	9,187,090.00	0.38
37	002385	大北农	1,176,300	9,186,903.00	0.38
38	688122	西部超导	98,800	9,109,360.00	0.37
39	601108	财通证券	1,154,000	9,081,980.00	0.37
40	300363	博腾股份	115,900	9,039,041.00	0.37

41	002268	卫 士 通	210,300	9,023,973.00	0.37
42	688099	晶晨股份	87,692	8,856,892.00	0.36
43	600486	扬农化工	66,000	8,796,480.00	0.36
44	603345	安井食品	51,900	8,712,453.00	0.36
45	600298	安琪酵母	177,600	8,658,000.00	0.35
46	000519	中兵红箭	296,700	8,648,805.00	0.35
47	300144	宋城演艺	556,900	8,548,415.00	0.35
48	000630	铜陵有色	2,616,400	8,529,464.00	0.35
49	600862	XD中航高	295,400	8,300,740.00	0.34
50	000988	华工科技	357,300	8,278,641.00	0.34
51	603605	珀莱雅	49,900	8,242,482.00	0.34
52	002353	杰瑞股份	204,000	8,221,200.00	0.34
53	000783	长江证券	1,376,000	8,159,680.00	0.33
54	601168	西部矿业	676,800	8,006,544.00	0.33
55	002625	光启技术	459,000	7,926,930.00	0.32
56	601696	中银证券	591,800	7,870,940.00	0.32
57	300146	汤臣倍健	362,600	7,850,290.00	0.32
58	601162	天风证券	2,461,200	7,826,616.00	0.32
59	002028	思源电气	216,800	7,731,088.00	0.32
60	300724	捷佳伟创	86,500	7,728,775.00	0.32
61	688777	中控技术	105,800	7,698,008.00	0.31
62	002056	横店东磁	288,800	7,687,856.00	0.31
63	601077	渝农商行	2,061,000	7,625,700.00	0.31
64	002507	涪陵榨菜	220,572	7,614,145.44	0.31
65	002797	第一创业	1,187,500	7,611,875.00	0.31
66	603517	绝味食品	130,910	7,569,216.20	0.31
67	600988	赤峰黄金	472,700	7,539,565.00	0.31
68	603589	口子窖	127,800	7,490,358.00	0.31
69	000932	华菱钢铁	1,470,600	7,485,354.00	0.31
70	002185	华天科技	793,590	7,443,874.20	0.30
71	601128	常熟银行	974,300	7,443,652.00	0.30

72	603026	XD石大胜	50,300	7,311,105.00	0.30
73	601636	旗滨集团	572,300	7,296,825.00	0.30
74	600521	华海药业	319,200	7,245,840.00	0.30
75	002603	以岭药业	296,500	7,204,950.00	0.29
76	600039	四川路桥	682,500	7,186,725.00	0.29
77	002326	永太科技	217,900	7,175,447.00	0.29
78	600109	国金证券	792,600	7,133,400.00	0.29
79	601607	上海医药	394,300	7,128,944.00	0.29
80	605117	德业股份	25,400	7,109,206.00	0.29
81	000830	鲁西化工	408,900	7,069,881.00	0.29
82	002078	太阳纸业	572,300	7,045,013.00	0.29
83	002624	完美世界	482,200	6,929,214.00	0.28
84	600153	建发股份	529,300	6,917,951.00	0.28
85	688390	固德威	21,920	6,861,179.20	0.28
86	600546	山煤国际	352,300	6,855,758.00	0.28
87	603939	益丰药房	127,100	6,714,693.00	0.27
88	603267	鸿远电子	49,400	6,635,902.00	0.27
89	002422	科伦药业	354,700	6,632,890.00	0.27
90	601872	招商轮船	1,151,300	6,631,488.00	0.27
91	600348	华阳股份	427,400	6,607,604.00	0.27
92	600705	中航产融	1,902,300	6,581,958.00	0.27
93	600497	驰宏锌锗	1,265,100	6,565,869.00	0.27
94	000738	航发控制	233,600	6,564,160.00	0.27
95	601990	南京证券	786,200	6,556,908.00	0.27
96	600177	雅戈尔	987,300	6,545,799.00	0.27
97	600549	厦门钨业	302,600	6,542,212.00	0.27
98	000831	五矿稀土	209,111	6,534,718.75	0.27
99	300699	光威复材	110,400	6,499,248.00	0.27
100	000970	中科三环	345,807	6,494,255.46	0.27
101	600875	东方电气	394,600	6,491,170.00	0.27
102	603127	昭衍新药	56,900	6,475,220.00	0.26

103	300088	长信科技	872,600	6,474,692.00	0.26
104	300676	华大基因	88,300	6,331,110.00	0.26
105	000999	华润三九	140,200	6,309,000.00	0.26
106	600160	巨化股份	479,600	6,306,740.00	0.26
107	600859	王府井	241,300	6,268,974.00	0.26
108	002138	顺络电子	229,100	6,242,975.00	0.26
109	002572	索菲亚	226,700	6,234,250.00	0.25
110	000998	隆平高科	374,100	6,232,506.00	0.25
111	601699	潞安环能	425,200	6,216,424.00	0.25
112	600516	方大炭素	811,700	6,168,920.00	0.25
113	002557	洽洽食品	108,040	6,150,717.20	0.25
114	002673	西部证券	938,300	6,136,482.00	0.25
115	600143	金发科技	638,900	6,082,328.00	0.25
116	002508	老板电器	168,700	6,078,261.00	0.25
117	000807	云铝股份	615,200	6,078,176.00	0.25
118	000039	中集集团	436,500	6,045,525.00	0.25
119	601997	贵阳银行	1,038,300	6,032,523.00	0.25
120	600482	中国动力	383,500	6,024,785.00	0.25
121	002030	达安基因	349,220	6,003,091.80	0.25
122	002273	水晶光电	493,600	5,977,496.00	0.24
123	000960	锡业股份	355,900	5,968,443.00	0.24
124	002465	海格通信	654,555	5,949,904.95	0.24
125	603444	吉比特	15,300	5,936,400.00	0.24
126	300357	我武生物	111,800	5,816,954.00	0.24
127	000629	攀钢钒钛	1,525,000	5,795,000.00	0.24
128	300058	蓝色光标	885,600	5,782,968.00	0.24
129	300136	信维通信	342,800	5,776,180.00	0.24
130	000728	国元证券	928,000	5,772,160.00	0.24
131	000975	银泰黄金	591,520	5,761,404.80	0.24
132	600170	上海建工	1,896,900	5,747,607.00	0.23
133	600536	中国软件	140,660	5,709,389.40	0.23

134	002092	中泰化学	731,605	5,677,254.80	0.23
135	600704	物产中大	1,104,600	5,666,598.00	0.23
136	601577	长沙银行	713,800	5,660,434.00	0.23
137	689009	九号公司	126,900	5,647,050.00	0.23
138	002409	雅克科技	101,500	5,634,265.00	0.23
139	600079	人福医药	348,300	5,572,800.00	0.23
140	002294	信立泰	197,900	5,560,990.00	0.23
141	603198	迎驾贡酒	85,300	5,556,442.00	0.23
142	600739	辽宁成大	380,200	5,543,316.00	0.23
143	300474	景嘉微	80,260	5,488,981.40	0.22
144	002223	鱼跃医疗	213,909	5,488,904.94	0.22
145	300244	迪安诊断	176,482	5,488,590.20	0.22
146	300418	昆仑万维	340,400	5,446,400.00	0.22
147	000547	航天发展	455,400	5,437,476.00	0.22
148	600415	小商品城	976,100	5,436,877.00	0.22
149	002372	伟星新材	226,076	5,434,867.04	0.22
150	002506	协鑫集成	1,455,700	5,415,204.00	0.22
151	000636	风华高科	288,000	5,411,520.00	0.22
152	002739	万达电影	395,900	5,404,035.00	0.22
153	300558	贝达药业	88,600	5,386,880.00	0.22
154	300253	卫宁健康	610,880	5,363,526.40	0.22
155	600699	均胜电子	340,400	5,347,684.00	0.22
156	600372	中航电子	273,800	5,308,982.00	0.22
157	300308	中际旭创	170,500	5,294,025.00	0.22
158	300296	利亚德	722,200	5,272,060.00	0.22
159	600637	东方明珠	727,300	5,200,195.00	0.21
160	002683	广东宏大	186,400	5,187,512.00	0.21
161	600867	通化东宝	500,200	5,172,068.00	0.21
162	600315	上海家化	120,800	5,164,200.00	0.21
163	600985	淮北矿业	352,900	5,138,224.00	0.21
164	601016	节能风电	1,069,200	5,132,160.00	0.21

165	600236	桂冠电力	840,600	5,119,254.00	0.21
166	000887	中鼎股份	280,400	5,114,496.00	0.21
167	601198	东兴证券	573,900	5,107,710.00	0.21
168	600026	中远海能	493,500	5,097,855.00	0.21
169	002156	通富微电	330,700	5,092,780.00	0.21
170	002299	圣农发展	265,400	5,090,372.00	0.21
171	600171	上海贝岭	201,800	5,051,054.00	0.21
172	002065	东华软件	798,200	5,044,624.00	0.21
173	300832	新产业	111,697	5,038,651.67	0.21
174	600879	航天电子	773,500	5,020,015.00	0.21
175	600380	XD健康元	402,400	4,969,640.00	0.20
176	600642	申能股份	873,400	4,960,912.00	0.20
177	300026	红日药业	640,700	4,933,390.00	0.20
178	600258	XD首旅酒	198,800	4,930,240.00	0.20
179	000750	国海证券	1,355,600	4,920,828.00	0.20
180	002408	齐翔腾达	606,280	4,916,930.80	0.20
181	002936	郑州银行	1,825,700	4,911,133.00	0.20
182	000623	吉林敖东	330,600	4,879,656.00	0.20
183	688185	康希诺	24,400	4,857,552.00	0.20
184	000729	燕京啤酒	499,300	4,823,238.00	0.20
185	000513	丽珠集团	133,132	4,820,709.72	0.20
186	600673	东阳光	536,100	4,819,539.00	0.20
187	000878	云南铜业	422,900	4,816,831.00	0.20
188	002203	海亮股份	416,200	4,807,110.00	0.20
189	000400	许继电气	250,000	4,800,000.00	0.20
190	600820	隧道股份	782,600	4,789,512.00	0.20
191	600038	中直股份	105,000	4,746,000.00	0.19
192	600529	山东药玻	169,200	4,729,140.00	0.19
193	600801	华新水泥	241,900	4,719,469.00	0.19
194	600580	卧龙电驱	327,100	4,716,782.00	0.19
195	601717	郑煤机	327,200	4,714,952.00	0.19

196	002439	启明星辰	235,700	4,697,501.00	0.19
197	600369	西南证券	1,181,400	4,690,158.00	0.19
198	002183	怡亚通	646,400	4,660,544.00	0.19
199	300383	光环新网	447,200	4,659,824.00	0.19
200	300017	网宿科技	868,800	4,656,768.00	0.19
201	002131	利欧股份	2,389,400	4,635,436.00	0.19
202	600166	福田汽车	1,637,300	4,633,559.00	0.19
203	603568	伟明环保	138,800	4,631,756.00	0.19
204	600316	洪都航空	152,800	4,620,672.00	0.19
205	688256	寒武纪	71,200	4,606,640.00	0.19
206	002958	青农商行	1,382,500	4,589,900.00	0.19
207	002444	巨星科技	243,558	4,588,632.72	0.19
208	002195	二三四五	2,035,400	4,579,650.00	0.19
209	600909	华安证券	1,002,910	4,563,240.50	0.19
210	600325	华发股份	602,000	4,557,140.00	0.19
211	600027	华电国际	1,158,900	4,554,477.00	0.19
212	601005	重庆钢铁	2,383,300	4,552,103.00	0.19
213	600008	首创环保	1,565,650	4,540,385.00	0.19
214	600848	上海临港	332,900	4,514,124.00	0.18
215	300001	特锐德	258,900	4,481,559.00	0.18
216	300618	寒锐钴业	77,000	4,459,840.00	0.18
217	300024	机器人	440,410	4,439,332.80	0.18
218	002926	华西证券	559,200	4,384,128.00	0.18
219	002373	千方科技	393,400	4,374,608.00	0.18
220	603218	日月股份	172,000	4,368,800.00	0.18
221	000825	太钢不锈	801,200	4,366,540.00	0.18
222	002430	杭氧股份	139,600	4,363,896.00	0.18
223	688521	芯原股份	88,100	4,352,140.00	0.18
224	000050	深天马 A	436,300	4,349,911.00	0.18
225	000027	深圳能源	676,400	4,335,724.00	0.18
226	000739	普洛药业	209,600	4,326,144.00	0.18

227	600271	航天信息	395,300	4,324,582.00	0.18
228	002500	山西证券	749,336	4,301,188.64	0.18
229	002250	联化科技	262,600	4,298,762.00	0.18
230	002212	天融信	420,812	4,271,241.80	0.17
231	600863	内蒙华电	1,158,600	4,228,890.00	0.17
232	600118	中国卫星	210,300	4,222,824.00	0.17
233	601866	中远海发	1,407,500	4,222,500.00	0.17
234	603233	大参林	134,800	4,219,240.00	0.17
235	600208	新湖中宝	1,528,400	4,218,384.00	0.17
236	002670	国盛金控	438,800	4,212,480.00	0.17
237	688009	中国通号	919,400	4,164,882.00	0.17
238	300677	英科医疗	164,000	4,159,040.00	0.17
239	000060	中金岭南	929,100	4,143,786.00	0.17
240	002985	北摩高科	70,681	4,140,492.98	0.17
241	002249	大洋电机	672,700	4,130,378.00	0.17
242	300009	安科生物	407,960	4,124,475.60	0.17
243	601992	金隅集团	1,482,300	4,105,971.00	0.17
244	000778	新兴铸管	849,300	4,093,626.00	0.17
245	002152	广电运通	441,250	4,090,387.50	0.17
246	600066	宇通客车	472,200	4,084,530.00	0.17
247	603156	养元饮品	179,700	4,082,784.00	0.17
248	603658	安图生物	83,500	4,082,315.00	0.17
249	300070	碧水源	773,000	4,027,330.00	0.16
250	300182	捷成股份	732,100	4,026,550.00	0.16
251	603858	步长制药	202,900	3,999,159.00	0.16
252	300168	万达信息	421,600	3,979,904.00	0.16
253	000401	冀东水泥	378,000	3,976,560.00	0.16
254	002966	苏州银行	650,889	3,970,422.90	0.16
255	600998	九州通	332,600	3,961,266.00	0.16
256	600056	中国医药	266,441	3,948,655.62	0.16
257	300251	光线传媒	416,700	3,946,149.00	0.16

258	002191	劲嘉股份	365,400	3,917,088.00	0.16
259	002128	电投能源	272,800	3,906,496.00	0.16
260	600390	五矿资本	798,500	3,904,665.00	0.16
261	002831	裕同科技	132,100	3,903,555.00	0.16
262	600970	中材国际	402,200	3,897,318.00	0.16
263	000997	新大陆	293,400	3,875,814.00	0.16
264	000021	深科技	332,300	3,867,972.00	0.16
265	300482	万孚生物	94,720	3,856,051.20	0.16
266	002505	鹏都农牧	1,131,600	3,836,124.00	0.16
267	002244	滨江集团	441,900	3,822,435.00	0.16
268	002221	东华能源	409,900	3,816,169.00	0.16
269	600021	上海电力	372,200	3,815,050.00	0.16
270	600062	华润双鹤	148,500	3,810,510.00	0.16
271	600528	中铁工业	473,300	3,810,065.00	0.16
272	000656	金科股份	1,327,100	3,795,506.00	0.16
273	600667	XD太极实	511,800	3,777,084.00	0.15
274	600839	四川长虹	1,311,000	3,775,680.00	0.15
275	603885	吉祥航空	209,700	3,772,503.00	0.15
276	688002	睿创微纳	94,904	3,769,586.88	0.15
277	600827	百联股份	285,200	3,767,492.00	0.15
278	000987	越秀金控	534,630	3,758,448.90	0.15
279	002396	星网锐捷	165,700	3,751,448.00	0.15
280	600297	广汇汽车	1,434,800	3,744,828.00	0.15
281	603707	健友股份	132,670	3,741,294.00	0.15
282	600598	北大荒	252,700	3,729,852.00	0.15
283	002127	南极电商	697,200	3,723,048.00	0.15
284	002019	亿帆医药	263,000	3,676,740.00	0.15
285	600498	烽火通信	253,400	3,669,232.00	0.15
286	600201	生物股份	400,407	3,667,728.12	0.15
287	600155	华创阳安	432,400	3,666,752.00	0.15
288	002266	浙富控股	762,500	3,652,375.00	0.15

289	600259	广晟有色	71,800	3,636,670.00	0.15
290	002155	湖南黄金	298,600	3,625,004.00	0.15
291	000012	南玻A	488,000	3,620,960.00	0.15
292	600409	三友化工	439,200	3,597,048.00	0.15
293	000930	中粮科技	397,800	3,596,112.00	0.15
294	600511	国药股份	133,900	3,585,842.00	0.15
295	000883	湖北能源	700,000	3,577,000.00	0.15
296	600718	东软集团	309,200	3,558,892.00	0.15
297	002153	石基信息	224,040	3,555,514.80	0.15
298	002124	天邦食品	522,380	3,510,393.60	0.14
299	002511	中顺洁柔	279,700	3,501,844.00	0.14
300	000686	东北证券	499,200	3,489,408.00	0.14
301	600060	海信视像	278,800	3,485,000.00	0.14
302	600959	江苏有线	1,065,500	3,473,530.00	0.14
303	603712	七一二	109,900	3,461,850.00	0.14
304	600282	南钢股份	1,094,200	3,446,730.00	0.14
305	600566	济川药业	126,400	3,433,024.00	0.14
306	000581	威孚高科	178,100	3,428,425.00	0.14
307	600782	新钢股份	679,400	3,424,176.00	0.14
308	600895	张江高科	274,800	3,421,260.00	0.14
309	601880	辽港股份	2,005,900	3,410,030.00	0.14
310	688188	柏楚电子	15,490	3,408,419.60	0.14
311	000709	河钢股份	1,507,600	3,407,176.00	0.14
312	601179	中国西电	727,800	3,406,104.00	0.14
313	000690	宝新能源	772,398	3,383,103.24	0.14
314	600064	南京高科	307,500	3,382,500.00	0.14
315	600022	山东钢铁	1,942,600	3,380,124.00	0.14
316	600535	天士力	319,700	3,360,047.00	0.14
317	002939	长城证券	330,500	3,357,880.00	0.14
318	300376	易事特	410,800	3,335,696.00	0.14
319	601778	晶科科技	616,400	3,328,560.00	0.14

320	002701	奥瑞金	639,357	3,324,656.40	0.14
321	600755	厦门国贸	440,400	3,303,000.00	0.13
322	002002	鸿达兴业	886,700	3,289,657.00	0.13
323	600216	浙江医药	240,500	3,282,825.00	0.13
324	300630	普利制药	93,253	3,277,842.95	0.13
325	600500	中化国际	491,300	3,267,145.00	0.13
326	600808	马钢股份	857,900	3,251,441.00	0.13
327	000598	兴蓉环境	636,000	3,249,960.00	0.13
328	600037	歌华有线	345,900	3,248,001.00	0.13
329	600663	陆家嘴	313,000	3,242,680.00	0.13
330	002468	申通快递	271,800	3,239,856.00	0.13
331	002532	天山铝业	495,900	3,238,227.00	0.13
332	600728	佳都科技	499,800	3,228,708.00	0.13
333	600567	山鹰国际	1,151,000	3,188,270.00	0.13
334	688208	道通科技	96,092	3,163,348.64	0.13
335	600517	国网英大	608,900	3,160,191.00	0.13
336	002004	华邦健康	562,200	3,137,076.00	0.13
337	603866	桃李面包	189,356	3,133,841.80	0.13
338	601456	国联证券	255,400	3,133,758.00	0.13
339	603225	新凤鸣	271,500	3,133,110.00	0.13
340	002595	豪迈科技	139,600	3,118,664.00	0.13
341	300463	迈克生物	152,200	3,118,578.00	0.13
342	002429	兆驰股份	806,300	3,096,192.00	0.13
343	000785	居然之家	695,400	3,094,530.00	0.13
344	688289	圣湘生物	104,480	3,093,652.80	0.13
345	002745	木林森	316,600	3,093,182.00	0.13
346	600597	光明乳业	244,600	3,089,298.00	0.13
347	300115	长盈精密	298,743	3,080,040.33	0.13
348	601958	金钼股份	344,800	3,048,032.00	0.12
349	688006	杭可科技	43,101	3,019,656.06	0.12
350	300888	稳健医疗	45,400	3,019,100.00	0.12

351	300166	东方国信	327,300	3,017,706.00	0.12
352	601106	中国一重	974,000	2,990,180.00	0.12
353	601860	紫金银行	1,040,200	2,985,374.00	0.12
354	002390	信邦制药	431,700	2,983,047.00	0.12
355	300072	三聚环保	584,200	2,956,052.00	0.12
356	603927	中科软	126,640	2,953,244.80	0.12
357	600507	方大特钢	415,300	2,902,947.00	0.12
358	601118	海南橡胶	607,100	2,901,938.00	0.12
359	601718	际华集团	935,900	2,901,290.00	0.12
360	000540	中天金融	1,497,600	2,890,368.00	0.12
361	600737	中粮糖业	379,700	2,855,344.00	0.12
362	600572	康恩贝	640,700	2,838,301.00	0.12
363	000089	深圳机场	363,800	2,808,536.00	0.11
364	002048	宁波华翔	174,000	2,787,480.00	0.11
365	000559	万向钱潮	469,160	2,786,810.40	0.11
366	603883	DR老百姓	81,874	2,773,891.12	0.11
367	002368	太极股份	144,320	2,772,387.20	0.11
368	600967	内蒙一机	302,900	2,762,448.00	0.11
369	000898	鞍钢股份	851,300	2,741,186.00	0.11
370	600435	北方导航	317,700	2,738,574.00	0.11
371	600871	石化油服	1,444,900	2,730,861.00	0.11
372	002690	美亚光电	125,390	2,718,455.20	0.11
373	600582	天地科技	567,800	2,714,084.00	0.11
374	601000	唐山港	1,051,900	2,713,902.00	0.11
375	001914	招商积余	150,500	2,704,485.00	0.11
376	601568	北元集团	424,350	2,690,379.00	0.11
377	002110	三钢闽光	436,500	2,658,285.00	0.11
378	600195	中牧股份	216,400	2,653,064.00	0.11
379	600556	天下秀	321,800	2,648,414.00	0.11
380	000959	首钢股份	555,400	2,643,704.00	0.11
381	600398	海澜之家	555,000	2,636,250.00	0.11

382	002281	光迅科技	149,400	2,626,452.00	0.11
383	601333	广深铁路	1,204,200	2,625,156.00	0.11
384	002233	塔牌集团	296,500	2,624,025.00	0.11
385	000156	华数传媒	328,500	2,618,145.00	0.11
386	002705	新宝股份	117,500	2,583,825.00	0.11
387	000537	广宇发展	198,500	2,578,515.00	0.11
388	600811	东方集团	909,100	2,572,753.00	0.11
389	688321	微芯生物	102,022	2,569,934.18	0.11
390	003035	南网能源	403,800	2,564,130.00	0.10
391	002010	传化智联	397,900	2,558,497.00	0.10
392	002174	游族网络	261,100	2,550,947.00	0.10
393	600764	中国海防	101,000	2,549,240.00	0.10
394	000402	金融街	423,978	2,522,669.10	0.10
395	600329	达仁堂	102,100	2,509,618.00	0.10
396	000937	冀中能源	333,900	2,490,894.00	0.10
397	600120	浙江东方	616,760	2,473,207.60	0.10
398	300212	易华录	141,680	2,465,232.00	0.10
399	000488	晨鸣纸业	436,200	2,460,168.00	0.10
400	002416	爱施德	264,500	2,459,850.00	0.10
401	600126	杭钢股份	479,900	2,457,088.00	0.10
402	603638	艾迪精密	119,680	2,453,440.00	0.10
403	000990	诚志股份	223,000	2,441,850.00	0.10
404	600167	联美控股	325,200	2,435,748.00	0.10
405	600446	金证股份	234,600	2,435,148.00	0.10
406	601200	上海环境	239,000	2,428,240.00	0.10
407	002867	周大生	155,750	2,418,797.50	0.10
408	000685	中山公用	314,750	2,417,280.00	0.10
409	002081	金螳螂	475,600	2,416,048.00	0.10
410	601098	中南传媒	254,800	2,405,312.00	0.10
411	600373	中文传媒	240,600	2,403,594.00	0.10
412	002925	盈趣科技	111,490	2,399,264.80	0.10

413	002382	蓝帆医疗	251,000	2,397,050.00	0.10
414	600707	彩虹股份	510,200	2,387,736.00	0.10
415	000158	常山北明	397,800	2,386,800.00	0.10
416	601611	中国核建	282,100	2,366,819.00	0.10
417	001965	招商公路	307,400	2,345,462.00	0.10
418	600095	湘财股份	304,300	2,340,067.00	0.10
419	002399	海普瑞	133,100	2,339,898.00	0.10
420	002146	荣盛发展	772,200	2,339,766.00	0.10
421	601608	中信重工	615,700	2,333,503.00	0.10
422	688029	南微医学	26,664	2,325,100.80	0.10
423	603317	天味食品	81,420	2,318,027.40	0.09
424	002387	维信诺	343,000	2,304,960.00	0.09
425	600131	国网信通	169,900	2,285,155.00	0.09
426	000967	盈峰环境	451,500	2,284,590.00	0.09
427	688088	虹软科技	71,961	2,273,247.99	0.09
428	002948	青岛银行	626,020	2,266,192.40	0.09
429	000528	柳工	346,800	2,257,668.00	0.09
430	600376	首开股份	457,900	2,248,289.00	0.09
431	601187	厦门银行	375,000	2,235,000.00	0.09
432	600623	华谊集团	268,100	2,225,230.00	0.09
433	603000	人民网	197,100	2,207,520.00	0.09
434	002423	中粮资本	328,300	2,202,893.00	0.09
435	000563	陕国投 A	702,800	2,192,736.00	0.09
436	600901	江苏租赁	423,700	2,173,581.00	0.09
437	601598	中国外运	560,000	2,172,800.00	0.09
438	600307	酒钢宏兴	1,111,700	2,156,698.00	0.09
439	600006	东风汽车	284,100	2,144,955.00	0.09
440	601991	大唐发电	879,800	2,137,914.00	0.09
441	603228	景旺电子	90,900	2,120,697.00	0.09
442	300257	开山股份	140,900	2,107,864.00	0.09
443	000961	中南建设	681,400	2,078,270.00	0.08

444	603650	彤程新材	63,700	2,075,346.00	0.08
445	600906	财达证券	230,200	2,069,498.00	0.08
446	600717	天津港	514,260	2,062,182.60	0.08
447	002242	九阳股份	109,400	2,008,584.00	0.08
448	002434	万里扬	232,900	1,991,295.00	0.08
449	000718	苏宁环球	539,400	1,984,992.00	0.08
450	601928	凤凰传媒	271,400	1,940,510.00	0.08
451	000671	阳光城	883,200	1,934,208.00	0.08
452	000415	渤海租赁	878,000	1,905,260.00	0.08
453	000553	安道麦A	154,200	1,867,362.00	0.08
454	601969	海南矿业	217,200	1,865,748.00	0.08
455	600968	海油发展	721,600	1,861,728.00	0.08
456	000031	大悦城	454,300	1,817,200.00	0.07
457	600648	外高桥	132,800	1,806,080.00	0.07
458	600787	中储股份	311,700	1,773,573.00	0.07
459	600928	西安银行	473,700	1,738,479.00	0.07
460	600339	中油工程	595,700	1,721,573.00	0.07
461	002563	森马服饰	287,800	1,703,776.00	0.07
462	601228	广州港	440,700	1,617,369.00	0.07
463	300869	康泰医学	57,100	1,613,646.00	0.07
464	002815	崇达技术	124,400	1,593,564.00	0.07
465	000028	国药一致	53,011	1,579,197.69	0.06
466	600835	上海机电	114,300	1,569,339.00	0.06
467	688819	天能股份	45,000	1,556,100.00	0.06
468	600377	宁沪高速	176,700	1,514,319.00	0.06
469	000717	韶钢松山	430,400	1,506,400.00	0.06
470	603056	德邦股份	109,800	1,474,614.00	0.06
471	002945	华林证券	95,700	1,459,425.00	0.06
472	603379	三美股份	65,140	1,449,365.00	0.06
473	000869	张裕A	47,931	1,425,467.94	0.06
474	601139	深圳燃气	203,700	1,413,678.00	0.06

475	000062	深圳华强	111,052	1,410,360.40	0.06
476	600299	安迪苏	143,100	1,370,898.00	0.06
477	601298	青岛港	249,600	1,365,312.00	0.06
478	601869	长飞光纤	43,300	1,338,836.00	0.05
479	603868	飞科电器	17,100	1,295,325.00	0.05
480	001872	招商港口	80,000	1,248,000.00	0.05
481	601156	东航物流	62,100	1,229,580.00	0.05
482	002653	海思科	76,006	1,224,456.66	0.05
483	300741	华宝股份	43,800	1,218,516.00	0.05
484	600823	世茂股份	398,100	1,186,338.00	0.05
485	600350	山东高速	221,800	1,164,450.00	0.05
486	601828	美凯龙	191,400	1,159,884.00	0.05
487	600927	永安期货	56,400	1,137,588.00	0.05
488	001227	兰州银行	221,700	1,090,764.00	0.04
489	603355	莱克电气	41,120	1,037,457.60	0.04
490	603786	科博达	15,700	966,649.00	0.04
491	603515	欧普照明	53,600	935,320.00	0.04
492	001203	大中矿业	80,100	905,130.00	0.04
493	601665	齐鲁银行	177,900	868,152.00	0.04
494	603719	良品铺子	28,800	824,544.00	0.03
495	002946	新乳业	61,138	794,182.62	0.03
496	601003	柳钢股份	181,000	733,050.00	0.03
497	002901	大博医疗	16,300	637,982.00	0.03
498	600956	新天绿能	49,400	608,608.00	0.02
499	603983	丸美股份	18,600	498,480.00	0.02
500	600917	重庆燃气	60,800	438,976.00	0.02

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

1	688400	凌云光	13,111	287,524.23	0.01
2	688320	禾川科技	6,048	279,478.08	0.01
3	301175	中科环保	63,694	243,311.08	0.01
4	301139	元道通信	5,651	217,337.46	0.01
5	301239	普瑞眼科	5,747	193,386.55	0.01
6	688251	井松智能	3,392	124,350.72	0.01
7	688237	超卓航科	2,891	119,311.57	0.00
8	301238	瑞泰新材	3,497	112,148.79	0.00
9	688283	坤恒顺维	1,595	72,428.95	0.00
10	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.00
11	301217	铜冠铜箔	4,284	63,531.72	0.00
12	301219	腾远钴业	578	50,759.96	0.00
13	301200	大族数控	857	44,495.44	0.00
14	301206	三元生物	945	43,177.05	0.00
15	601089	N福元	1,749	36,816.45	0.00
16	301216	万凯新材	1,120	33,420.80	0.00
17	301207	华兰疫苗	569	32,102.98	0.00
18	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.00
19	301109	军信股份	1,838	29,665.32	0.00
20	301302	华如科技	466	26,291.72	0.00
21	301266	宇邦新材	517	24,335.19	0.00
22	301268	铭利达	641	22,351.67	0.00
23	301263	泰恩康	682	21,401.16	0.00
24	301102	兆讯传媒	642	19,959.78	0.00
25	301187	欧圣电气	876	19,745.04	0.00
26	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
27	301112	C信邦	399	17,970.96	0.00
28	301153	中科江南	398	17,504.04	0.00
29	301123	奕东电子	656	16,655.84	0.00
30	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00
31	301120	新特电气	1,032	15,985.68	0.00

32	301235	华康医疗	418	15,854.74	0.00
33	301286	侨源股份	784	15,515.36	0.00
34	301151	冠龙节能	703	15,086.38	0.00
35	301160	翔楼新材	392	14,762.72	0.00
36	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
37	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.00
38	301298	东利机械	634	13,206.22	0.00
39	301258	富士莱	295	12,295.60	0.00
40	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
41	301097	天益医疗	249	11,909.67	0.00
42	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
43	001268	N联合	409	11,337.48	0.00
44	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.00
45	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
46	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
47	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
48	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
49	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
50	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
51	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
52	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
53	301110	青木股份	202	8,049.70	0.00
54	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
55	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
56	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00
57	301279	金道科技	296	6,751.76	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	300769	德方纳米	14,162,835.40	0.60
2	600096	云天化	13,827,074.70	0.58
3	300012	华测检测	13,726,873.84	0.58
4	002497	雅化集团	13,211,805.00	0.56
5	002240	盛新锂能	12,852,078.47	0.54
6	300390	天华超净	10,997,161.00	0.46
7	002407	多氟多	10,875,375.18	0.46
8	688180	君实生物	10,624,333.27	0.45
9	601058	赛轮轮胎	9,959,284.80	0.42
10	300073	当升科技	9,900,955.08	0.42
11	002756	永兴材料	9,838,481.00	0.41
12	688122	西部超导	9,104,133.97	0.38
13	601108	财通证券	8,824,831.38	0.37
14	688777	中控技术	8,818,961.22	0.37
15	000783	长江证券	8,142,838.00	0.34
16	600499	科达制造	8,011,941.88	0.34
17	601162	天风证券	7,984,300.00	0.34
18	601696	中银证券	7,847,940.00	0.33
19	603345	安井食品	7,547,074.66	0.32
20	002625	光启技术	7,469,890.00	0.31

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（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	000733	振华科技	17,149,279.00	0.72
2	600188	兖矿能源	15,034,283.00	0.63
3	002340	格林美	14,602,124.00	0.61

4	688005	容百科技	13,028,045.53	0.55
5	300751	迈为股份	12,470,245.40	0.53
6	601117	中国化学	12,337,466.79	0.52
7	000723	美锦能源	11,634,508.93	0.49
8	600884	杉杉股份	10,938,544.00	0.46
9	605358	立昂微	10,188,529.94	0.43
10	601689	拓普集团	9,868,409.00	0.42
11	600754	锦江酒店	9,647,641.00	0.41
12	300763	锦浪科技	9,378,710.50	0.39
13	002013	中航机电	9,087,960.56	0.38
14	603290	斯达半导	7,051,550.00	0.30
15	300223	北京君正	6,948,153.00	0.29
16	688536	思瑞浦	6,877,444.34	0.29
17	600733	北汽蓝谷	6,804,732.51	0.29
18	600803	新奥股份	6,413,326.00	0.27
19	603893	瑞芯微	6,059,439.00	0.26
20	002080	中材科技	5,880,786.00	0.25

注：本项的“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 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	772,073,436.59
卖出股票收入（成交）总额	518,528,075.47

注：本项“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	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)	146,527.61	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	146,527.61	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	占基金资产净值比例（%）
1	127064	杭氧转债	1,465	146,527.61	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

在实际进行投资运作时，由于ETF基金一般需要满仓操作，同时基金需要备出一定的现金头存应对申赎及费用等支付，因此仓位无法达到100%，这时基金仓位就存在裸露风险，通过套期保值方式买入期货合约，可以使基金仓位达到100%，避免仓位暴露的风险。股指期货在买入时总持仓量采用双限制策略，一是限制基金组合中总的股指期货持仓量不能超过向中金所申请并获批的套保总量；二是限制基金组合持有的股指期货合约价值加上基金组合中其他有价证券市值占基金净资产的比例不能超过法规规定的上限，并在股指期货的交易过程中严格遵守基金合同的约束和中金所的规定。根据本基金的基金合同、投资范围、投资目标、投资策略以及对市场走势研判的基础上，结合基金日常

的申购赎回情况，制定套期保值交易的合理期限。套期保值的期限一般不超过股指期货当前的最远到期日合约，即次季合约。按照交易月份相近的原则，综合考虑并动态跟踪不同到期日的期货合约的流动性、价差状况和展期风险等因素，选择合适月份的期货合约进行开仓和展期交易来实现远期套保的目的。另外对于交割月的股指期货，通常情况下，最晚在合约交割日进行平仓，尽量避免进行交割。在未来的股指期货交易过程中，本基金将严格遵守《证券投资基金参与股指期货交易指引》，以及中国金融期货交易所颁布的《中国金融期货交易所交易规则》、《中国金融期货交易所套期保值与套利交易管理办法》等相关规定，以套期保值为主要目的参与股指期货，严格控制交易中的各种风险。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内未发现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查，未发现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.12.2 基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	13,947,427.16
2	应收清算款	18,362.34
3	应收股利	398,127.82
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	54,488.40
7	待摊费用	75,616.24
8	其他	-

9	合计	14,494,021.96
---	----	---------------

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	601615	明阳智能	4,147,260.00	0.17	转融通证券出借
2	600522	中天科技	3,298,680.00	0.13	转融通证券出借
3	600096	云天化	2,880,420.00	0.12	转融通证券出借
4	002240	盛新锂能	2,589,444.00	0.11	转融通证券出借
5	600256	广汇能源	2,534,870.00	0.10	转融通证券出借
6	002497	雅化集团	1,968,795.00	0.08	转融通证券出借
7	300012	华测检测	1,736,108.00	0.07	转融通证券出借
8	002407	多氟多	1,496,646.00	0.06	转融通证券出借

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688400	凌云光	287,524.23	0.01	新股未上市
2	688320	禾川科技	279,478.08	0.01	科创板打新

					限售
3	301175	中科环保	243,311.08	0.01	新股未上市
4	301139	元道通信	217,337.46	0.01	新股未上市
5	301239	普瑞眼科	193,386.55	0.01	新股未上市

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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		联接基金	
		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
5,952	400,102.23	18,748,528.00	0.79%	82,392,173.00	3.46%	2,280,267,769.00	95.75%

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	国泰君安证券股份有限公司一天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金	2,280,267,769.00	95.75%
2	中国国际金融股份有限公司	4,220,296.00	0.18%
3	兴证风险管理有限公司	3,173,500.00	0.13%

		0	
4	广发证券股份有限公司	3,027,038.00	0.13%
5	中信建投证券股份有限公司	2,507,654.00	0.11%
6	赵梦野	2,400,000.00	0.10%
7	新疆友好（集团）股份有限公司	2,068,600.00	0.09%
8	张如依	2,045,100.00	0.09%
9	刘国胜	1,981,700.00	0.08%
10	方正证券股份有限公司	1,886,532.00	0.08%

注：持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	2,000.00	0.00%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2020年08月07日)基金份额总额	333,908,470.00
本报告期期初基金份额总额	2,056,408,470.00
本报告期基金总申购份额	457,500,000.00

减：本报告期基金总赎回份额	132,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,381,408,470.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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，本基金的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，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生变化。

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

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员没有发生受稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数	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	

	量					
安信证券	3	410,223,567.21	32.36%	177,068.60	32.38%	-
东方财富证券	2	41,341,753.37	3.26%	17,817.37	3.26%	-
方正证券	5	303,989,762.54	23.98%	131,131.79	23.98%	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	42,542,612.34	3.36%	18,349.18	3.36%	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券	8	394,156.50	0.03%	-	-	-
海通证券	3	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	26,127,929.89	2.06%	11,269.07	2.06%	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	2	28,531,141.85	2.25%	12,308.79	2.25%	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	368,587,144.77	29.07%	158,972.45	29.08%	-
信达证券	1	44,659,108.62	3.52%	19,263.91	3.52%	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信	2	1,351,211.20	0.11%	583.01	0.11%	-

建投 证券						
----------	--	--	--	--	--	--

注：1、基金专用交易单元的选择标准为：该证券经营机构财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，内控制度健全，最近两年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；研究实力较强，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、市场分析报告、行业研究报告、个股分析报告及全面的信息服务等。

2、基金专用交易单元的选择程序：本基金管理人根据上述标准进行考察后，确定选用交易席位的证券经营机构。然后基金管理人和被选用的证券经营机构签订交易席位租用协议。

3、本基金报告期内新租用交易单元：恒泰证券上海交易单元、恒泰证券深圳交易单元、华鑫证券深圳交易单元、江海证券上海交易单元、江海证券深圳交易单元。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	422,619.42	11.87%	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	1,467,400.00	41.21%	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	777,696.15	21.84%	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	630,527.56	17.71%	-	-	-	-	-	-
信达证券	262,870.20	7.38%	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	天弘基金管理有限公司关于旗下资产管理产品执行新金融工具相关会计准则的公告	证券时报、中国证监会指定媒介	2022-01-04
2	天弘基金管理有限公司公告	证券时报、中国证监会指定媒介	2022-01-22
3	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金2021年第四季度报告	证券时报、中国证监会指定媒介	2022-01-24
4	天弘基金管理有限公司公告	证券时报、中国证监会指定媒介	2022-03-05
5	天弘基金管理有限公司公告	证券时报、中国证监会指定媒介	2022-03-17
6	天弘基金管理有限公司运用固有资金投资旗下公募基金的公告	证券时报、中国证监会指定媒介	2022-03-17
7	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）	证券时报、中国证监会指定媒介	2022-03-18
8	天弘基金管理有限公司公告	证券时报、中国证监会指定媒介	2022-03-23
9	天弘基金管理有限公司公告	证券时报、中国证监会指定媒介	2022-03-24
10	天弘基金管理有限公司公告	证券时报、中国证监会指定媒介	2022-03-28
11	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金2021年年度报告	证券时报、中国证监会指定媒介	2022-03-31
12	天弘基金管理有限公司公告	证券时报、中国证监会指定媒介	2022-03-31
13	天弘基金管理有限公司公告	证券时报、中国证监会指定媒介	2022-04-08

14	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	证券时报、中国证监会指定媒介	2022-04-14
15	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金2022年第一季度报告	证券时报、中国证监会指定媒介	2022-04-22
16	天弘基金管理有限公司关于终止深圳前海凯恩斯基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	证券时报、中国证监会指定媒介	2022-04-22
17	天弘基金管理有限公司关于设立浙江分公司公告	证券时报、中国证监会指定媒介	2022-04-26
18	天弘基金管理有限公司关于注销天津理财中心的公告	证券时报、中国证监会指定媒介	2022-05-06
19	天弘基金管理有限公司公告	证券时报、中国证监会指定媒介	2022-06-01
20	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	证券时报、中国证监会指定媒介	2022-06-02

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
联接基金	1	20220101-20220630	1,933,324,319.00	433,403,700.00	86,460,250.00	2,280,267,769.00	95.75%
产品特有风险							

基金管理人秉承谨慎勤勉、独立决策、规范运作、充分披露原则，公平对待投资者，保障投资者合法权益。当单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%时，由此可能导致的特有风险主要包括：

(1) 超出基金管理人允许的单一投资者持有基金份额比例的申购申请不被确认的风险；

(2) 极端市场环境下投资者集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对赎回申请的风险；

(3) 持有基金份额占比较高的投资者大额赎回可能引发基金净值大幅波动的风险；

(4) 持有基金份额占比较高的投资者在召开基金份额持有人大会并对重大事项进行投票表决时，可能拥有较大话语权；

(5) 极端情况下，持有基金份额占比较高的投资者大量赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换基金运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。

注：1、申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

2、份额占比精度处理方式四舍五入。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》（财会〔2017〕7号）、《企业会计准则第23号—金融资产转移》（财会〔2017〕8号）、《企业会计准则第24号—套期会计》（财会〔2017〕9号）、《企业会计准则第37号—金融工具列报》（财会〔2017〕14号）和《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》（财会〔2020〕22号）等相关规定，自 2022年1月1日起，天弘基金管理有限公司旗下资产管理产品开始执行新金融工具相关会计准则。具体信息请参见基金管理人在规定媒介披露的《天弘基金管理有限公司关于旗下资产管理产品执行新金融工具相关会计准则的公告》。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- 2、天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- 3、天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- 4、天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金招募说明书
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告
- 6、中国证监会规定的其他文件

12.2 存放地点

天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

12.3 查阅方式

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

公司网站：www.thfund.com.cn

天弘基金管理有限公司
二〇二二年八月三十一日