

汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

送出日期：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。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	17
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
§ 6 半年度财务会计报告 (未经审计)	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	19
6.3 净资产 (基金净值) 变动表	20
6.4 报表附注	22
§ 7 投资组合报告	100
7.1 期末基金资产组合情况	100
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	100
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	101
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	124
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	126
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	126
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	127
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	127
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	127

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	127
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	127
7.12 投资组合报告附注.....	127
§ 8 基金份额持有人信息	128
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	128
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	129
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	130
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.....	130
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况.....	130
§ 9 开放式基金份额变动	130
§ 10 重大事件揭示	131
10.1 基金份额持有人大会决议.....	131
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.....	131
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	131
10.4 基金投资策略的改变.....	131
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	131
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.....	131
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	131
10.8 其他重大事件.....	133
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	133
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况.....	133
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	133
§ 12 备查文件目录	133
12.1 备查文件目录.....	133
12.2 存放地点	134
12.3 查阅方式	134

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）	
基金简称	汇添富中证 500 指数（LOF）	
基金主代码	501036	
基金运作方式	上市契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 08 月 10 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额（份）	364,972,105.67	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所	
上市日期	2017 年 10 月 09 日	
下属分级基金的基金简称	汇添富中证 500 指数（LOF）A	汇添富中证 500 指数（LOF）C
下属分级基金场内简称	中证 500A	中证 500C
下属分级基金的交易代码	501036	501037
报告期末下属分级基金的份额总额（份）	242,091,866.05	122,880,239.62

注：A 类份额扩位证券简称：中证 500LOF；C 类份额扩位证券简称：中证 500LOFC。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金采用被动式指数化投资方法，按照标的指数的成份股及其权重来构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，以更好地实现本基金的投资目标。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。本基金的投资策略主要包括：股票投资策略、固定收益类资产投资策略、金融衍生工具投资策略、融资及转融通投资策略、存托凭证的投资策略。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*95%+银行人民币活期存款利率(税后)*5%

风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。
--------	--

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	汇添富基金管理股份有限公司	招商证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏
	联系电话	021-28932888
	电子邮箱	service@99fund.com
客户服务电话	400-888-9918	95565
传真	021-28932998	0755-82960794
注册地址	上海市黄浦区北京东路666号H区（东座）6楼H686室	深圳市福田区福华一路111号
办公地址	上海市黄浦区外马路728号	深圳市福田区福华一路111号
邮政编码	200010	518000
法定代表人	李文	霍达

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022年01月01日 - 2022年06月30日)	
	汇添富中证500指数（LOF）A	汇添富中证500指数（LOF）C
本期已实现收益	336,267.74	-10,751.98
本期利润	-25,509,301.53	-14,149,166.59
加权平均基金份额本期利润	-0.1133	-0.1192

本期加权平均净值利润率	-9.85%	-10.47%
本期基金份额净值增长率	-10.20%	-10.31%
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	44,287,950.55	20,864,683.20
期末可供分配基金份额利润	0.1829	0.1698
期末基金资产净值	286,379,816.60	143,744,922.82
期末基金份额净值	1.1829	1.1698
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	18.29%	16.98%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富中证 500 指数 (LOF) A						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	7.54%	1.04%	6.74%	1.05%	0.80%	-0.01%
过去三个月	3.43%	1.63%	1.99%	1.66%	1.44%	-0.03%
过去六个月	-10.20%	1.52%	-11.65%	1.55%	1.45%	-0.03%
过去一年	-1.41%	1.24%	-4.83%	1.26%	3.42%	-0.02%
过去三	49.09%	1.25%	29.13%	1.28%	19.96%	-0.03%

年						
自基金合同生效日起至今	18.29%	1.31%	2.38%	1.33%	15.91%	-0.02%
汇添富中证 500 指数 (LOF) C						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	7.52%	1.04%	6.74%	1.05%	0.78%	-0.01%
过去三个月	3.37%	1.63%	1.99%	1.66%	1.38%	-0.03%
过去六个月	-10.31%	1.52%	-11.65%	1.55%	1.34%	-0.03%
过去一年	-1.66%	1.24%	-4.83%	1.26%	3.17%	-0.02%
过去三年	47.98%	1.25%	29.13%	1.28%	18.85%	-0.03%
自基金合同生效日起至今	16.98%	1.31%	2.38%	1.33%	14.60%	-0.02%

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

汇添富中证500指数（LOF）A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富中证500指数（LOF）C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



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

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金管理股份有限公司经中国证监会证监基金字【2005】5 号文批准，于 2005 年 2 月 3 日正式成立。目前，公司注册资本为 132,724,224 元人民币。公司总部设立于上海，在北京、上海、广州、成都、南京、深圳等地设有分公司，在香港、上海、美国设有子公司——汇添富资产管理（香港）有限公司、汇添富资本管理有限公司、汇添富资产管理（美国）控股有限公司。公司及旗下子公司业务牌照齐全，拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII 基金管理人、RQFII 基金管理人、QFII 基金管理人、基金投资顾问等业务资格。

汇添富基金自成立以来，形成了独树一帜的品牌优势，被誉为“选股专家”，并以优秀的长期投资业绩和一流的客户服务，赢得了广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

2022 上半年，汇添富基金新成立 26 只公开募集证券投资基金，包括 11 只股票型基金、11 只混合型基金、4 只债券型基金。截至 2022 年 6 月 30 日，公司共管理 252 只公开募集证券投资基金，形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征，较为完善、有效的产品线。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限（年）	说明
		任职日期	离任日期		
吴振翔	本基金的基金经理, 指数与量化投资部副总监	2017 年 08 月 10 日		16	国籍：中国。学历：中国科学技术大学管理学博士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、上投摩根基金管理有限公司产品开发高级经理。2008 年 3 月

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

				<p>理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 11 月 6 日至今任汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2015 年 2 月 16 日至今任汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金的基金经理。2015 年 3 月 24 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2016 年 1 月 21 日至今任汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2016 年 7 月 28 日至今任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月 22 日至今任汇添富中证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2017 年 8 月 10 日至今任汇添</p>
--	--	--	--	--

				<p>富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2018 年 3 月 23 日至今任汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理。2019 年 7 月 26 日至 2022 年 6 月 13 日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 9 月 24 日至 2022 年 6 月 13 日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 11 月 6 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 3 月 5 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 10 月 29 日至今任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	---

					<p>2022 年 1 月 11 日至今任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。</p> <p>2022 年 1 月 27 日至今任汇添富中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2022 年 4 月 28 日至今任汇添富中证沪港深张江自主创新 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

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

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

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本基金无重大违法、违规行为,本基金投资运作符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内, 本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内, 本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 18 次, 投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控, 事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析, 未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾上半年, 国内外风险事件对制造业生产和居民消费造成一些影响, 房地产等部分传统经济仍不景气。市场经历了一季度的下跌后, 4 月下旬, A 股宽基指数的 PE、PB 等估值指标进入历史底部区域, 5、6 月份, 随着稳增长政策发力, 银行信贷投放改善, 流动性环境趋向宽松, 同时国内经济保持韧性, 出口持续超预期, 在估值修复和基本面因素改善的共同推动下, 市场出现较显著的反弹。

海外方面, 地区冲突对全球供应链造成剧烈冲击, 能源、资源、农产品价格整体上涨, 抬升通胀预期。美联储加息落地, 对全球金融市场流动性和资金流向形成一定影响, 成长风格回调明显。海外经济压力逐步显现, 通胀持续超预期, 市场开始交易衰退预期。

风格方面, 一季度小盘价值风格表现较好; 4 月份市场情绪相对悲观, 安全性高的大盘价值风格表现最佳; 随着市场企稳和投资者风险偏好提升, 5、6 月份, 成长风格, 尤其是

前期调整充分, 基本面稳健的大盘成长开始有出色表现。行业方面, 一季度煤炭、房地产、建筑领衔的周期板块涨幅居前, 二季度在市场反弹过程中, 前期调整充分、受益于政策扶持、叠加行业高景气的汽车、新能源板块, 和受益于疫情后修复的消费板块整体表现出色。

报告期内, 本基金遵循被动指数投资原则, 基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富中证 500 指数 (LOF) A 类份额净值增长率为-10.20%, 同期业绩比较基准收益率为-11.65%。本报告期汇添富中证 500 指数 (LOF) C 类份额净值增长率为-10.31%, 同期业绩比较基准收益率为-11.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年, 积极因素在逐步显现, 有利因素包括: 国内经济保持韧性; 不断强化的稳增长政策以及丰富的政策储备; A 股的整体估值水平合理, 和其他市场相比处于相对较低的位置。不利因素包括海外经济衰退、高通胀以及地区冲突增加了外部宏观环境的不确定性; 赚钱效应减弱可能降低投资者的风险偏好。

中证 500 指数是一个行业分布非常均衡的宽基指数, 这在当前市场环境下, 将是一个较好的选择, 因为其承载的特定风险将较小。往后看, 中国经济正在结构转型, 在这个过程中, 必将有很多中小公司成长为大公司, 在这一过程中, 中证 500 指数将充分受益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内, 本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定。对于特定品种或者投资品种相同, 但具有不同特征的, 若协会有特定调整估值方法的通知的, 例如《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》, 应参照协会通知执行。

报告期内, 公司制定了证券投资基金的估值政策和程序, 并由投资研究部、固定收益部、集中交易室、基金营运部、风险管理及合规稽核人员、基金经理等组成了估值委员会, 负责研究、指导基金估值业务。估值委员会成员均为公司各部门人员, 均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经验, 且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值委员会的成员, 不介入基金日常估值业务但应参加估值小组会议, 可以提议测算某一投资品种的估值调整影响, 并有权表决有关议案但仅享有一票表决权, 从而将其影响程度进行适当限制, 保证基金估值的公平、合理, 保持估值政策和程序的一贯性。

日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行,基金份额净值由本基金管理人完成估值后,经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

本基金本报告期内未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告 (未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF)

报告截止日: 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	21,195,895.69	23,719,024.89
结算备付金		7,666,292.90	8,101,772.97
存出保证金		1,270,727.63	1,666,597.68
交易性金融资产	6.4.7.2	399,315,771.52	371,264,731.69
其中: 股票投资		397,661,821.62	371,126,184.49
基金投资		-	-
债券投资		1,653,949.90	138,547.20
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中: 债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		74,113.30	-
应收申购款		2,948,185.32	2,151,364.56
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	11,040.52	20,747.72
资产总计		432,482,026.88	406,924,239.51
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		0.42	-
应付赎回款		1,819,287.50	2,184,614.79
应付管理人报酬		171,078.99	167,256.94
应付托管费		34,215.79	33,451.36
应付销售服务费		28,834.14	28,730.40
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,445.62	47,920.79
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-

其他负债	6.4.7.7	302,425.00	353,783.72
负债合计		2,357,287.46	2,815,758.00
净资产:			
实收基金	6.4.7.8	364,972,105.67	307,839,443.93
未分配利润	6.4.7.9	65,152,633.75	96,269,037.58
净资产合计		430,124,739.42	404,108,481.51
负债和净资产总计		432,482,026.88	406,924,239.51

注: 报告截止日 2022 年 06 月 30 日, 基金份额总额 364,972,105.67 份。本基金下属 A 类基金份额净值 1.1829 元, 基金份额总额 242,091,866.05 份; 本基金下属 C 类基金份额净值 1.1698 元, 基金份额总额 122,880,239.62 份。

比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示: 上年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年末”余额, 上年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年末”余额。

6.2 利润表

会计主体: 汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF)

本报告期: 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 2021 年 06 月 30 日
一、营业总收入		-38,193,387.29	30,846,060.87
1. 利息收入		572,815.57	509,593.18
其中: 存款利息收入	6.4.7.10	232,329.93	117,389.66
债券利息收入		-	136,032.00
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		340,485.64	256,171.52
其他利息收入		-	-
2. 投资收益 (损失以“-”填列)		1,190,007.70	35,921,966.25
其中: 股票投资收益	6.4.7.11	-2,229,055.95	32,607,739.84
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	9,417.11	152,101.94
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-1,037,561.64	891,223.30
股利收益	6.4.7.17	4,447,208.18	2,270,901.17

以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	6.4.7.18	-39,983,983.88	-5,617,070.51
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	6.4.7.19	27,773.32	31,571.95
减: 二、营业总支出		1,465,080.83	1,698,866.11
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	975,348.91	755,466.25
2. 托管费	6.4.10.2.2	195,069.76	151,093.28
3. 销售服务费		167,174.49	136,440.15
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		1,227.23	3,208.80
8. 其他费用	6.4.7.21	126,260.44	652,657.63
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		-39,658,468.12	29,147,194.76
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		-39,658,468.12	29,147,194.76
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-39,658,468.12	29,147,194.76

注: 比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示: 上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产 (基金净值) 变动表

会计主体: 汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF)

本报告期: 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	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	307,839,443.93	96,269,037.58	404,108,481.51
加: 会计政策变	-	-	-

更			
二、本期期初净资产(基金净值)	307,839,443.93	96,269,037.58	404,108,481.51
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	57,132,661.74	-31,116,403.83	26,016,257.91
(一)、综合收益总额	-	-39,658,468.12	-39,658,468.12
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	57,132,661.74	8,542,064.29	65,674,726.03
其中:1.基金申购款	247,134,666.82	38,067,308.99	285,201,975.81
2.基金赎回款	-190,002,005.08	-29,525,244.70	-219,527,249.78
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	364,972,105.67	65,152,633.75	430,124,739.42
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	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	313,853,303.79	27,900,366.00	341,753,669.79
加:会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	313,853,303.79	27,900,366.00	341,753,669.79
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-58,972,903.59	22,056,714.16	-36,916,189.43
(一)、综合收益总额	-	29,147,194.76	29,147,194.76
(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)	-58,972,903.59	-7,090,480.60	-66,063,384.19

“-”号填列)			
其中: 1. 基金申购款	326,341,284.44	38,330,462.14	364,671,746.58
2. 基金赎回款	-385,314,188.03	-45,420,942.74	-430,735,130.77
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	254,880,400.20	49,957,080.16	304,837,480.36

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”), 系经中国证券监督管理委员会 (以下简称“中国证监会”) 证监许可[2017]770 号文《关于准予汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 注册的批复》准予注册, 由汇添富基金管理股份有限公司作为基金发起人向社会公开募集。基金合同于 2017 年 8 月 10 日生效, 首次设立募集规模为 735,804,689.63 份基金份额。本基金为上市契约型开放式 (LOF), 存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司, 注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司, 基金托管人为招商证券股份有限公司。

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标, 基金还可投资于其他股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、债券(包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券(分离交易可转债)、中小企业私募债券等)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括定期存款、协议存款及其他银行存款)、货币市场工具、金融衍生工具(包括股指期货、权证、国债期货、股票期权等)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他

金融工具 (但须符合中国证监会的相关规定)。本基金进行被动式指数化投资, 紧密跟踪标的的指数, 追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金的业绩比较基准为: 中证 500 指数收益率 $\times 95\%$ + 银行人民币活期存款利率 (税后) $\times 5\%$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金于 2022 年 06 月 30 日的财务状况以及 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

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

除下述变更后的会计政策外, 本基金报告期所采用的其他会计政策、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

金融工具是指形成本基金的金融资产 (或负债), 并形成其他单位的金融负债 (或资产) 或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产;

(2) 金融负债分类

本基金的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、以摊余成本计量的金融负债。

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为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,以及不作为有效套期工具的衍生工具,按照取得时的公允价值作为初始确认金额,相关的交易费用在发生时计入当期损益;

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债,按照取得时的公允价值作为初始确认金额,相关交易费用计入其初始确认金额;

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,采用公允价值进行后续计量,所有公允价值变动计入当期损益;

对于以摊余成本计量的金融资产,采用实际利率法确认利息收入,其终止确认、修改或减值产生的利得或损失,均计入当期损益;

本基金以预期信用损失为基础,对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项,本基金运用简化计量方法,按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产,本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加,如果信用风险自初始确认后未显著增加,处于第一阶段,本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备,并按照账面余额和实际利率计算利息收入;如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的,处于第二阶段,本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备,并按照账面余额和实际利率计算利息收入;如果初始确认后发生信用减值的,处于第三阶段,本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备,并按照摊余成本和实际利率计算利息收入;

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础,通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险,以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况;

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括:通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值,以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息;

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时,该金融资产成为已发生信用减值的金融资产;

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时,本基金直接减记该金融资产的账面余额;

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止,或该收取金融资产现金流量的权利已转移,且符合金融资产转移的终止确认条件的,金融资产将终止确认;

本基金已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的,终止确认该金融资产;保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,不终止确认该金融资产;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的,分别下列情况处理:放弃了对该金融资产控制的,终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债;未放弃对该金融资产控制的,按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产,并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债(含交易性金融负债和衍生金融负债),按照公允价值进行后续计量,所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债,采用实际利率法,按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满,则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.3 收入/(损失)的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款,按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入,并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失,列入利息收入减项,存款利息收入以净额列示;

(2)交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用,计入投资收益;

债券投资和资产支持证券投资持有期间,按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益,在证券实际持有期内逐日计提;

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认,并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账,同时转出已确认的公允价值变动收益;

(3)股利收益于除息日确认,并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账;

(4)处置衍生工具的投资收益于成交日确认,并按处置衍生工具成交金额与其成本的差

额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账, 同时转出已确认的公允价值变动收益;

(5) 买入返售金融资产收入, 按实际利率法确认利息收入, 在回购期内逐日计提;

(6) 公允价值变动收益系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失;

(7) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额, 在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息, 实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入;

(8) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

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

根据《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》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(统称“新金融工具准则”)、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求, 本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理, 根据衔接规定, 对可比期间信息不予调整, 首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式, 确定了三个主要的计量类别: 摊余成本; 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益; 以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式, 以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”, 适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中, 并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中, 不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目, 反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中, 其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日 (2022 年 1 月 1 日), 原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述:

以摊余成本计量的金融资产:

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 23,719,024.89 元, 自应收利息转入的重分类金额为人民币 10,169.36 元, 重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后, 银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 23,729,194.25 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 8,101,772.97 元, 自应收利息转入的重分类金额为人民币 1,975.61 元, 重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后, 结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 8,103,748.58 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,666,597.68 元, 自应收利息转入的重分类金额为人民币 32.45 元, 重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后, 存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,666,630.13 元。

其他资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 0.00 元, 自应收利息转入的重分类金额为人民币 6,759.14 元, 重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后, 其他资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 6,759.14 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 20,747.72 元, 转出至银行存款的重分类金额为人民币 10,169.36 元, 转出至结算备付金的重分类金额为人民币 1,975.61 元, 转出至存出保证金的重分类金额为人民币 32.45 元, 转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 1,811.16 元, 转出至其他资产的重分类金额为人民币 6,759.14 元。经上述重分类后, 应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产:

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 371,264,731.69 元, 自应收利息转入的重分类金额为人民币 1,811.16 元。经上述重分类后, 交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 371,266,542.85 元。

除上述财务报表项目外,于首次执行日,新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日,新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

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

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

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

2. 增值税

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定,金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单

以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

4. 企业所得税

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

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

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

5. 个人所得税

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

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

得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 06 月 30 日
活期存款	21,195,895.69
等于：本金	21,187,428.09
加：应计利息	8,467.60
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	21,195,895.69

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	405,845,886.50	-	397,661,821.62	-8,184,064.88

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	1,622,825.00	14,633.66	1,653,949.90
	银行间市场	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	1,622,825.00	14,633.66	1,653,949.90
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	407,468,711.50	14,633.66	399,315,771.52	-8,167,573.64

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	-	-	-	-
（国债期货投资）	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
（外汇期货投资）	-	-	-	-
权益衍生工具	7,395,840.00	-	-	-
（权证投资）	-	-	-	-
（股指期货投资）	7,395,840.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	7,395,840.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2209	IC2209	6	7,636,800.00	240,960.00
合计				240,960.00
减：可抵销期货暂收款				240,960.00
净额				-

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

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内不存在债权投资减值准备计提情况。

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 06 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	11,040.52
待摊费用	-
合计	11,040.52

6.4.7.7 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	2.22
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	118,518.48
其中：交易所市场	118,518.48
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	104,795.19
应付信息披露费	59,507.37
应付指数使用费	19,601.74
应付账户维护费	-
应付汇划费	-
应付上市费	-
应付持有人大会费-公证费	-
应付持有人大会费-律师费	-
其他	-
合计	302,425.00

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富中证 500 指数 (LOF) A		
项目	本期 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	202,719,670.47	202,719,670.47
本期申购	89,145,305.93	89,145,305.93
本期赎回 (以“-”号填列)	-49,773,110.35	-49,773,110.35
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	242,091,866.05	242,091,866.05
汇添富中证 500 指数 (LOF) C		
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	105,119,773.46	105,119,773.46
本期申购	157,989,360.89	157,989,360.89
本期赎回 (以“-”号填列)	-140,228,894.73	-140,228,894.73
基金拆分/份额折算	-	-

前		
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	122,880,239.62	122,880,239.62

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

汇添富中证 500 指数 (LOF) A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	65,785,363.91	-1,488,521.04	64,296,842.87
本期利润	336,267.74	-25,845,569.27	-25,509,301.53
本期基金份额交易产生的变动数	12,808,819.21	-7,308,410.00	5,500,409.21
其中：基金申购款	29,015,791.08	-15,792,710.40	13,223,080.68
基金赎回款	-16,206,971.87	8,484,300.40	-7,722,671.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	78,930,450.86	-34,642,500.31	44,287,950.55
汇添富中证 500 指数 (LOF) C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	32,789,050.93	-816,856.22	31,972,194.71
本期利润	-10,751.98	-14,138,414.61	-14,149,166.59
本期基金份额交易产生的变动数	5,562,081.15	-2,520,426.07	3,041,655.08
其中：基金申购款	49,308,163.40	-24,463,935.09	24,844,228.31
基金赎回款	-43,746,082.25	21,943,509.02	-21,802,573.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	38,340,380.10	-17,475,696.90	20,864,683.20

6.4.7.10 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	175,752.06
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	54,707.73
其他	1,870.14
合计	232,329.93

注：“其他”为结算保证金利息收入。

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益——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	74,630,828.69
减：卖出股票成本总额	76,596,287.22
减：交易费用	263,597.42
买卖股票差价收入	-2,229,055.95

6.4.7.11.2 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期无证券出借差价收入。

6.4.7.12 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	1,976.23
债券投资收益——买卖债券差价收入	7,440.88
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	9,417.11

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	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	161,837.58
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	151,776.00

减：应计利息总额	2,618.18
减：交易费用	2.52
买卖债券差价收入	7,440.88

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
股指期货投资收益	-1,037,561.64
外汇远期投资收益	-
外汇期货投资收益	-
国债期货投资收益	-

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	4,447,208.18
其中：证券出借权益补偿收入	421,590.09
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,447,208.18

6.4.7.18 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	-40,064,103.88
——股票投资	-40,074,223.92
——债券投资	10,120.04

——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	80,120.00
——权证投资	-
——期货投资	80,120.00
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	-39,983,983.88

6.4.7.19 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	27,773.32
替代损益	-
其他	-
合计	27,773.32

6.4.7.20 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	2,936.00
指数使用费	39,013.93
持有人大会-公证费	-
持有人大会-律师费	-
开户费	-
上市费	-
其他	7.95
合计	126,260.44

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日, 本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日, 本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内未发生与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注: 以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位: 人民币元

关联方名称	本期 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	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
招商证券	211,128,445.95	100.00	311,825,759.78	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位: 人民币元

关联方名称	本期 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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
招商证券	1,552,166.58	100.00	12,924,698.92	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
招商证券	151,646.47	100.00	118,518.48	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
招商证券	287,114.45	100.00	152,605.09	100.00

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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管理费	975,348.91	755,466.25
其中：支付销售机构的客户维护费	286,890.78	202,207.56

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期 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	195,069.76	151,093.28

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位: 人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	30,960.07	30,960.07
招商证券股份有限公司	-	187.42	187.42
东方证券股份有限公司	-	6,456.64	6,456.64
合计	-	37,604.13	37,604.13
获得销售服务费的各关联方名称	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销售服务费		
	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	20,416.64	20,416.64

招商证券股份 有限公司	-	99.90	99.90
东方证券股份 有限公司	-	7,790.30	7,790.30
合计	-	28,306.84	28,306.84

注：本基金 A 类基金份额不收取基金销售服务费，C 类基金份额的基金销售服务费年费率为 0.25%。

本基金基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

单位：人民币元

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

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 (单位: 股)	出借期限 (单位: 天)	费率	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
东方证券	2022011100000695	微芯生物	2022年01月11日	134,082.00	3,900.00	14	3.60	187.71	-	-
东方证券	2022011100000697	圣湘生物	2022年01月11日	66,100.00	1,000.00	14	3.60	92.54	-	-
东方证券	2022012500011880	圣湘生物	2022年01月25日	52,310.00	1,000.00	14	3.60	73.23	-	-
东方证券	2022012500011890	微芯生物	2022年01月25日	125,307.00	3,900.00	14	3.60	175.43	-	-
东	202202080001	微	202	117,234.	3,900.0	14	3.6	164.	-	-

方证券	5272	芯生物	2022年02月08日	00	0		0	13		
东方证券	2022020800015276	圣湘生物	2022年02月08日	51,310.00	1,000.00	14	3.60	71.83	-	-
东方证券	2022022200013703	微芯生物	2022年02月22日	114,855.00	3,900.00	14	3.60	160.80	-	-
东方证券	2022030700001323	三聚环保	2022年03月07日	7,400.00	1,000.00	14	3.40	9.78	-	-
招商证券	2022030700001331	捷成股份	2022年03月07日	27,888.00	4,800.00	14	4.00	43.38	-	-
招商证券	2022030700001337	碧水源	2022年03月07日	242,298.00	37,800.00	14	4.00	376.91	-	-
东方证	2022032100000740	昆仑万	2022年	16,550.00	1,000.00	14	3.40	25.01	-	-

券		维	03 月 21 日							
东方 证 券	202203210000 0741	景 嘉 微	202 2 年 03 月 21 日	108,000. 00	1,000.0 0	14	3.4 0	163. 20	-	-
东方 证 券	202203210000 0746	卫 宁 健 康	202 2 年 03 月 21 日	9,600.00	1,000.0 0	14	3.4 0	14.5 1	-	-
东方 证 券	202203210000 0749	长 盈 精 密	202 2 年 03 月 21 日	10,530.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	15.9 1	-	-
东方 证 券	202203210000 0752	中 际 旭 创	202 2 年 03 月 21 日	33,780.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	51.0 5	-	-
东方 证 券	202203210000 0754	网 宿 科 技	202 2 年 03 月 21 日	6,000.00	1,000.0 0	14	3.4 0	9.07	-	-
东方 证 券	202203210000 0758	国 瓷 材 料	202 2 年 03 月	34,250.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	51.7 6	-	-

			21 日							
东方证 券	202203210000 0760	信 维 通 信	202 2 年 03 月 21 日	18,700.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	28.2 6	-	-
招商证 券	202203210000 0761	万 孚 生 物	202 2 年 03 月 21 日	295,434. 00	5,400.0 0	14	4.0 0	525. 22	-	-
东方证 券	202203210000 0762	利 亚 德	202 2 年 03 月 21 日	7,540.00	1,000.0 0	14	3.4 0	11.3 9	-	-
东方证 券	202203210000 0764	光 线 传 媒	202 2 年 03 月 21 日	8,030.00	1,000.0 0	14	3.4 0	12.1 3	-	-
东方证 券	202203210000 0766	普 利 制 药	202 2 年 03 月 21 日	44,370.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	67.0 5	-	-
东方证 券	202203210000 0769	万 达 信 息	202 2 年 03 月 21 日	11,260.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	17.0 2	-	-

东方证券	2022032100028897	三聚环保	2022年03月21日	6,680.00	1,000.00	14	3.40	10.09	-	-
招商证券	2022032100033221	碧水源	2022年03月21日	224,910.00	37,800.00	14	4.00	399.84	-	-
招商证券	2022032800000336	康泰医学	2022年03月28日	71,694.00	2,100.00	14	3.60	100.37	-	-
招商证券	2022032800000338	碧水源	2022年03月28日	6,435.00	1,100.00	14	3.60	9.01	-	-
东方证券	2022040600052283	三聚环保	2022年04月06日	6,540.00	1,000.00	14	3.40	8.65	-	-
东方证券	2022040600060261	景嘉微	2022年04月06日	92,270.00	1,000.00	14	3.40	122.00	-	-
东方	2022040600060267	普利	2022	43,210.00	1,000.00	14	3.40	57.13	-	-

证 券		制 药	年 04 月 06 日							
东 方 证 券	202204060006 0271	万 达 信 息	202 2 年 04 月 06 日	10,750.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	14.2 1	-	-
东 方 证 券	202204060006 0273	卫 宁 健 康	202 2 年 04 月 06 日	9,510.00	1,000.0 0	14	3.4 0	12.5 7	-	-
东 方 证 券	202204060006 0277	昆 仑 万 维	202 2 年 04 月 06 日	17,420.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	23.0 3	-	-
东 方 证 券	202204060006 0283	国 瓷 材 料	202 2 年 04 月 06 日	34,710.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	45.8 9	-	-
东 方 证 券	202204060006 0289	长 盈 精 密	202 2 年 04 月 06 日	9,670.00	1,000.0 0	14	3.4 0	12.7 9	-	-
东 方 证 券	202204060006 0295	网 宿 科 技	202 2 年 04	5,920.00	1,000.0 0	14	3.4 0	7.83	-	-

			月 06 日							
东方 证 券	202204060006 0299	光线 传 媒	202 2 年 04 月 06 日	8,200.00	1,000.0 0	14	3.4 0	10.8 4	-	-
招商 证 券	202204060006 0863	碧水 源	202 2 年 04 月 06 日	229,824. 00	37,800. 00	14	4.0 0	357. 50	-	-
招商 证 券	202204060006 0867	万孚 生 物	202 2 年 04 月 06 日	265,356. 00	5,400.0 0	14	4.0 0	412. 78	-	-
东方 证 券	202204060006 6187	信维 通 信	202 2 年 04 月 06 日	17,710.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	23.4 2	-	-
东方 证 券	202204060006 6201	利亚 德	202 2 年 04 月 06 日	7,150.00	1,000.0 0	14	3.4 0	9.45	-	-
东方 证 券	202204060006 6203	中际 旭 创	202 2 年 04 月 06 日	30,100.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	39.8 0	-	-

			日							
招商 证券	202204110000 0849	万达信息	2022 年 04 月 11 日	190,617. 00	20,300. 00	14	3.6 0	266. 86	-	-
东方 证券	202204200004 3090	中际旭创	2022 年 04 月 20 日	29,930.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	42.4 0	-	-
东方 证券	202204200004 3118	景嘉微	2022 年 04 月 20 日	87,100.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	123. 39	-	-
东方 证券	202204200004 3120	万达信息	2022 年 04 月 20 日	9,320.00	1,000.0 0	14	3.4 0	13.2 0	-	-
东方 证券	202204200004 3124	卫宁健康	2022 年 04 月 20 日	8,130.00	1,000.0 0	14	3.4 0	11.5 2	-	-
东方 证券	202204200004 3130	利亚德	2022 年 04 月 20 日	6,610.00	1,000.0 0	14	3.4 0	9.36	-	-
东	202204200004	昆	202	15,030.0	1,000.0	14	3.4	21.2	-	-

方证券	3766	仑万维	2 年 04 月 20 日	0	0		0	9		
东方证券	202204200004 5002	三聚环保	202 2 年 04 月 20 日	5,900.00	1,000.0 0	14	3.4 0	8.36	-	-
东方证券	202204200004 5008	光线传媒	202 2 年 04 月 20 日	8,000.00	1,000.0 0	14	3.4 0	11.3 3	-	-
东方证券	202204200004 5012	网宿科技	202 2 年 04 月 20 日	5,380.00	1,000.0 0	14	3.4 0	7.62	-	-
东方证券	202204200004 5016	国瓷材料	202 2 年 04 月 20 日	32,120.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	45.5 0	-	-
东方证券	202204200004 5020	信维通信	202 2 年 04 月 20 日	16,070.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	22.7 7	-	-
东方证	202204200004 5022	长盈精	202 2 年	8,460.00	1,000.0 0	14	3.4 0	11.9 9	-	-

券		密	04 月 20 日							
东方 证 券	202204200004 5036	普 利 制 药	202 2 年 04 月 20 日	27,710.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	39.2 6	-	-
招 商 证 券	202204200004 5168	万 孚 生 物	202 2 年 04 月 20 日	245,160. 00	5,400.0 0	14	4.0 0	408. 60	-	-
招 商 证 券	202204200004 6942	碧 水 源	202 2 年 04 月 20 日	193,914. 00	37,800. 00	14	4.0 0	323. 19	-	-
东 方 证 券	202204250000 0572	碧 水 源	202 2 年 04 月 25 日	9,260.00	2,000.0 0	14	3.4 0	12.2 4	-	-
招 商 证 券	202204250000 6017	万 达 信 息	202 2 年 04 月 25 日	159,558. 00	20,300. 00	14	3.6 0	223. 38	-	-
东 方 证 券	202205050006 3195	中 际 旭 创	202 2 年 05 月	31,910.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	42.1 9	-	-

			05 日							
东方 证券	202205050006 3203	万 达 信 息	202 2 年 05 月 05 日	8,180.00	1,000.0 0	14	3.4 0	10.8 2	-	-
东方 证券	202205050006 3207	景 嘉 微	202 2 年 05 月 05 日	83,050.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	109. 81	-	-
东方 证券	202205050006 3209	利 亚 德	202 2 年 05 月 05 日	6,000.00	1,000.0 0	14	3.4 0	7.93	-	-
东方 证券	202205050006 3217	昆 仑 万 维	202 2 年 05 月 05 日	14,570.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	19.2 6	-	-
东方 证券	202205050006 3225	光 线 传 媒	202 2 年 05 月 05 日	7,000.00	1,000.0 0	14	3.4 0	9.26	-	-
东方 证券	202205050006 3231	卫 宁 健 康	202 2 年 05 月 05 日	8,090.00	1,000.0 0	14	3.4 0	10.7 0	-	-

东方 证 券	202205050006 4463	普 利 制 药	202 2 年 05 月 05 日	26,740.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	35.3 6	-	-
东方 证 券	202205050006 4483	网 宿 科 技	202 2 年 05 月 05 日	4,830.00	1,000.0 0	14	3.4 0	6.39	-	-
东方 证 券	202205050006 4493	三 聚 环 保	202 2 年 05 月 05 日	4,250.00	1,000.0 0	14	3.4 0	5.62	-	-
东方 证 券	202205050006 4507	国 瓷 材 料	202 2 年 05 月 05 日	32,290.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	42.6 9	-	-
招商 证 券	202205050006 4877	碧 水 源	202 2 年 05 月 05 日	175,014. 00	37,800. 00	14	4.0 0	272. 24	-	-
招商 证 券	202205050006 4887	万 孚 生 物	202 2 年 05 月 05 日	246,402. 00	5,400.0 0	14	4.0 0	383. 29	-	-
东 方	202205050007 3435	信 维	202 2	14,960.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	19.7 8	-	-

证 券		通 信	年 05 月 05 日							
东 方 证 券	202205050007 3437	长 盈 精 密	202 2 年 05 月 05 日	7,760.00	1,000.0 0	14	3.4 0	10.2 6	-	-
东 方 证 券	202205090000 0754	迈 为 股 份	202 2 年 05 月 09 日	485,400. 00	1,500.0 0	14	3.4 0	641. 81	-	-
东 方 证 券	202205090000 0756	景 嘉 微	202 2 年 05 月 09 日	154,422. 00	1,800.0 0	14	3.4 0	204. 18	-	-
东 方 证 券	202205090000 0762	利 亚 德	202 2 年 05 月 09 日	11,800.0 0	2,000.0 0	14	3.4 0	15.6 0	-	-
东 方 证 券	202205090000 0764	昆 仑 万 维	202 2 年 05 月 09 日	28,640.0 0	2,000.0 0	14	3.4 0	37.8 7	-	-
东 方 证 券	202205090000 0766	信 维 通 信	202 2 年 05 月	29,800.0 0	2,000.0 0	14	3.4 0	39.4 0	-	-

			月 09 日							
东方 证券	202205090000 0770	长盈 精密	202 2年 05月 09日	14,940.0 0	2,000.0 0	14	3.4 0	19.7 5	-	-
东方 证券	202205090000 0772	长信 科技	202 2年 05月 09日	11,820.0 0	2,000.0 0	14	3.4 0	15.6 3	-	-
东方 证券	202205090000 0774	国瓷 材料	202 2年 05月 09日	62,800.0 0	2,000.0 0	14	3.4 0	83.0 4	-	-
东方 证券	202205090000 0776	卫宁 健康	202 2年 05月 09日	16,180.0 0	2,000.0 0	14	3.4 0	21.3 9	-	-
东方 证券	202205090000 0778	光线 传媒	202 2年 05月 09日	13,680.0 0	2,000.0 0	14	3.4 0	18.0 9	-	-
东方 证券	202205090001 0249	碧水 源	202 2年 05月 09日	9,340.00	2,000.0 0	14	3.4 0	12.3 5	-	-

			日							
东方证券	202205190004 1549	三聚环保	2022年05月19日	4,650.00	1,000.00	14	3.40	6.15	-	-
东方证券	202205190004 1555	网宿科技	2022年05月19日	5,120.00	1,000.00	14	3.40	6.77	-	-
东方证券	202205190004 1561	光线传媒	2022年05月19日	7,120.00	1,000.00	14	3.40	9.41	-	-
东方证券	202205190004 3657	景嘉微	2022年05月19日	91,650.00	1,000.00	14	3.40	121.18	-	-
东方证券	202205190004 3671	中际旭创	2022年05月19日	31,180.00	1,000.00	14	3.40	41.23	-	-
东方证券	202205190004 3691	卫宁健康	2022年05月19日	8,270.00	1,000.00	14	3.40	10.93	-	-
东	202205190004	昆	202	14,720.0	1,000.0	14	3.4	19.4	-	-

方证券	3697	仑万维	2 年 05 月 19 日	0	0		0	6		
东方证券	202205190004 3709	信维通信	202 2 年 05 月 19 日	15,590.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	20.6 1	-	-
东方证券	202205190004 4045	利亚德	202 2 年 05 月 19 日	6,170.00	1,000.0 0	14	3.4 0	8.16	-	-
东方证券	202205190004 4051	普利制药	202 2 年 05 月 19 日	26,920.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	35.5 9	-	-
东方证券	202205190004 4057	长盈精密	202 2 年 05 月 19 日	8,470.00	1,000.0 0	14	3.4 0	11.2 0	-	-
东方证券	202205190004 4071	国瓷材料	202 2 年 05 月 19 日	33,180.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	43.8 7	-	-
招商证	202205190004 4425	碧水源	202 2 年	181,440. 00	37,800. 00	14	4.0 0	282. 24	-	-

券			05 月 19 日							
招商 证券	202205190004 5015	万孚 生物	202 2 年 05 月 19 日	220,914. 00	5,400.0 0	14	4.0 0	343. 64	-	-
东方 证券	202205230000 0619	中际 旭创	202 2 年 05 月 23 日	62,960.0 0	2,000.0 0	14	3.4 0	83.2 5	-	-
东方 证券	202205230000 6783	光线 传媒	202 2 年 05 月 23 日	14,840.0 0	2,000.0 0	14	3.4 0	19.6 2	-	-
东方 证券	202205230000 6801	碧水 源	202 2 年 05 月 23 日	9,780.00	2,000.0 0	14	3.4 0	12.9 3	-	-
东方 证券	202205230000 6817	长信 科技	202 2 年 05 月 23 日	13,560.0 0	2,000.0 0	14	3.4 0	17.9 3	-	-
东方 证券	202205230000 6843	利亚 德	202 2 年 05 月	12,520.0 0	2,000.0 0	14	3.4 0	16.5 5	-	-

			23 日							
东方 证券	202205230000 6849	长盈 精密	202 2 年 05 月 23 日	17,160.0 0	2,000.0 0	14	3.4 0	22.6 9	-	-
东方 证券	202205230000 6855	迈为 股份	202 2 年 05 月 23 日	562,200. 00	1,500.0 0	14	3.4 0	743. 35	-	-
东方 证券	202205230000 6865	昆仑 万维	202 2 年 05 月 23 日	30,000.0 0	2,000.0 0	14	3.4 0	39.6 7	-	-
东方 证券	202205230000 6869	国瓷 材料	202 2 年 05 月 23 日	66,740.0 0	2,000.0 0	14	3.4 0	88.2 5	-	-
东方 证券	202205230000 6929	景嘉 微	202 2 年 05 月 23 日	165,672. 00	1,800.0 0	14	3.4 0	219. 06	-	-
东方 证券	202205230000 6945	卫宁 健康	202 2 年 05 月 23 日	17,340.0 0	2,000.0 0	14	3.4 0	22.9 3	-	-

东方 证 券	202205230000 6953	信 维 通 信	202 2 年 05 月 23 日	31,540.0 0	2,000.0 0	14	3.4 0	41.7 0	-	-
东方 证 券	202206130000 3376	万 孚 生 物	202 2 年 06 月 13 日	80,100.0 0	2,000.0 0	14	3.4 0	105. 91	-	-
东方 证 券	202206130000 3378	中 际 旭 创	202 2 年 06 月 13 日	65,600.0 0	2,000.0 0	14	3.4 0	86.7 4	-	-
东方 证 券	202206130000 3380	开 山 股 份	202 2 年 06 月 13 日	29,340.0 0	2,000.0 0	14	3.4 0	38.7 9	-	-
东方 证 券	202206130000 3382	易 华 录	202 2 年 06 月 13 日	33,480.0 0	2,000.0 0	14	3.4 0	44.2 7	-	-
东方 证 券	202206130000 3384	万 达 信 息	202 2 年 06 月 13 日	18,160.0 0	2,000.0 0	14	3.4 0	24.0 1	-	-
东 方	202206130000 3386	三 聚	202 2	9,520.00	2,000.0 0	14	3.4 0	12.5 9	-	-

证 券		环 保	年 06 月 13 日							
东 方 证 券	202206130000 3390	机 器 人	202 2 年 06 月 13 日	16,940.0 0	2,000.0 0	14	3.4 0	22.4 0	-	-
东 方 证 券	202206130000 3392	网 宿 科 技	202 2 年 06 月 13 日	10,360.0 0	2,000.0 0	14	3.4 0	13.7 0	-	-
东 方 证 券	202206130000 3394	华 测 检 测	202 2 年 06 月 13 日	44,940.0 0	2,000.0 0	14	3.4 0	59.4 2	-	-
东 方 证 券	202206130000 3396	稳 健 医 疗	202 2 年 06 月 13 日	64,780.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	85.6 5	-	-
东 方 证 券	202206130000 3398	光 威 复 材	202 2 年 06 月 13 日	113,580. 00	2,000.0 0	14	3.4 0	150. 18	-	-
东 方 证 券	202206200000 1462	机 器 人	202 2 年 06	18,100.0 0	2,000.0 0	14	3.4 0	23.9 3	20,160.0 0	17.0 9

			月 20 日							
东方 证券	202206200000 1464	易 华 录	202 2 年 06 月 20 日	32,414.0 0	1,900.0 0	14	3.4 0	42.8 6	33,060.0 0	30.6 1
东方 证券	202206200000 1466	网 宿 科 技	202 2 年 06 月 20 日	10,640.0 0	2,000.0 0	14	3.4 0	14.0 7	10,720.0 0	10.0 5
东方 证券	202206200000 1468	华 测 检 测	202 2 年 06 月 20 日	44,400.0 0	2,000.0 0	14	3.4 0	58.7 1	46,420.0 0	41.9 4
东方 证券	202206200000 1470	稳 健 医 疗	202 2 年 06 月 20 日	83,239.0 0	1,300.0 0	14	3.4 0	110. 06	86,450.0 0	78.6 1
东方 证券	202206200000 1472	中 际 旭 创	202 2 年 06 月 20 日	64,740.0 0	2,000.0 0	14	3.4 0	85.6 0	62,100.0 0	61.1 4
东方 证券	202206200000 1474	光 威 复 材	202 2 年 06 月 20 日	111,260. 00	2,000.0 0	14	3.4 0	147. 11	117,740. 00	105. 08

			日							
东方证券	2022062700001198	中际旭创	2022年06月27日	62,000.00	2,000.00	14	3.40	81.98	62,100.00	17.57
东方证券	2022062700001208	华测检测	2022年06月27日	46,640.00	2,000.00	14	3.40	61.67	46,420.00	13.22
东方证券	2022062700001210	光威复材	2022年06月27日	91,360.00	1,600.00	14	3.40	120.80	94,192.00	25.89
东方证券	2022062700014230	万达信息	2022年06月27日	18,300.00	2,000.00	14	3.40	24.20	18,880.00	5.19
东方证券	2022062700014232	万孚生物	2022年06月27日	81,600.00	2,000.00	14	3.40	107.89	81,420.00	23.12
东方证券	2022062700014234	中际旭创	2022年06月27日	62,000.00	2,000.00	14	3.40	81.98	62,100.00	17.57
东	202206270001	开	202	29,580.0	2,000.0	14	3.4	39.1	29,920.0	8.38

方证券	4236	山股份	2 年 06 月 27 日	0	0		0	1	0	
东方证券	202206270001 4352	三聚环保	202 2 年 06 月 27 日	10,160.0 0	2,000.0 0	14	3.4 0	13.4 3	10,120.0 0	2.88
东方证券	202206270001 4354	网宿科技	202 2 年 06 月 27 日	10,640.0 0	2,000.0 0	14	3.4 0	14.0 7	10,720.0 0	3.02
东方证券	202206270001 4360	华测检测	202 2 年 06 月 27 日	46,640.0 0	2,000.0 0	14	3.4 0	61.6 7	46,420.0 0	13.2 2
东方证券	202206270001 4364	稳健医疗	202 2 年 06 月 27 日	64,960.0 0	1,000.0 0	14	3.4 0	85.8 9	66,500.0 0	18.4 1
东方证券	202206270001 4368	光威复材	202 2 年 06 月 27 日	114,200. 00	2,000.0 0	14	3.4 0	151. 00	117,740. 00	32.3 6
东方证	202206270001 4376	易华录	202 2 年	34,560.0 0	2,000.0 0	14	3.4 0	45.7 0	34,800.0 0	9.79

券			06 月 27 日							
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 (单位: 股)	出借期限 (单位: 天)	费率	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
				-	-		-	-	-	-

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注: 本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

注: 本基金本报告期末及上年度末均无由关联方保管的银行存款余额, 本报告期及上年度可比期间均未有由关联方保管银行存款而产生的利息收入。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注: 本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

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

6.4.12 期末 (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
300834	星辉环材	2022年01月06日	6个月	新股流通受限	55.57	30.03	216	12,003.12	6,486.48	
301103	何氏眼科	2022年03月14日	6个月	新股流通受限	32.71	32.02	421	13,770.00	13,480.42	
301109	军信股份	2022年04月06日	6个月	新股流通受限	23.19	16.14	764	17,718.29	12,330.96	
301110	青木股份	2022年03月04日	6个月	新股流通受限	63.10	39.85	187	11,799.70	7,451.95	
301116	益客食品	2022年01月10日	6个月	新股流通受限	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	
301117	佳缘科技	2022年01月07日	6个月	新股流通受限	46.80	54.44	262	12,261.60	14,263.28	
301135	瑞	2022	6	新	31.98	26.26	338	10,809.24	8,875.88	

	德智能	年04月01日	个月	股流通受限						
301148	嘉戎技术	2022年04月14日	6个月	新股流通受限	38.39	23.90	451	17,313.89	10,778.90	
301162	国能日新	2022年04月19日	6个月	新股流通受限	45.13	54.11	334	15,073.42	18,072.74	
301181	标榜股份	2022年02月11日	6个月	新股流通受限	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63	
301187	欧圣电气	2022年04月13日	6个月	新股流通受限	21.33	22.54	876	18,685.08	19,745.04	
301196	唯科科技	2022年01月04日	6个月	新股流通受限	64.08	37.52	152	9,740.16	5,703.04	
301200	大族数控	2022年02月18日	6个月	新股流通受限	76.56	51.92	223	17,072.88	11,578.16	
301201	诚达药	2022年01月12日	6个月	新股流	72.69	71.54	242	17,590.98	17,312.68	

	业	日		通					
301207	华 兰 疫 苗	2022 年 02 月 10 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	56.88	56.42	168	9,555.84	9,478.56
301212	联 盛 化 学	2022 年 04 月 07 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	29.67	33.28	416	12,342.72	13,844.48
301235	华 康 医 疗	2022 年 01 月 21 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	39.30	37.93	311	12,222.30	11,796.23
301263	泰 恩 康	2022 年 03 月 22 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	19.93	31.38	682	13,592.26	21,401.16
301268	铭 利 达	2022 年 03 月 29 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	28.50	34.87	435	12,397.50	15,168.45
688209	英 集 芯	2022 年 04 月 12 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	24.23	27.58	6,822	165,297.06	188,150.76
688295	中 复 神 鹰	2022 年 03 月 28 日	6 个 月	新 股 流 通 受	29.33	34.42	5,549	162,752.17	190,996.58

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年05月19日	32个交易日	新债流通受限	100.00	100.02	282	28,200.00	28,205.32	
6.4.12.1.3 受限证券类别：资产支持证券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位： 张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
					-	-	-	-	-	

注：本基金持有的流通受限股票“何氏眼科”（证券代码：301103）包含其新股发行后期根据权益分配方案以资本公积金转增获得的 97 股（根据何氏眼科 2021 年年度权益分派实施公告，何氏眼科以公司现有总股本 121,558,824 股为基数，向全体股东每 10 股派 6 元人民币现金，同时以资本公积金向全体股东每 10 股转增 3 股，除权除息日为 2022 年 6 月 1 日。）。本基金持有的流通受限股票“军信股份”（证券代码：301109）包含其新股发行后期根据权益分配方案以资本公积金转增获得的 255 股（根据军信股份 2021 年年度权益分派实施公告，军信股份以公司现有总股本 273,340,000 股为基数，向全体股东每 10 股派 3.80 元人民币现金，同时以资本公积金向全体股东每 10 股转增 5 股，除权除息日为 2022 年 6 月 17 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	2022年06	重大	9.60	2022年07	9.99	74,898	766,049.04	719,020.80	

	金 控	月 01 日	事 项 停 牌		月 14 日					
--	--------	-----------	------------------	--	-----------	--	--	--	--	--

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2022 年 06 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2022 年 06 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日		期末估值单价	数量(单位：张)	期末估值总额
1	601615	明阳智能	2022年07月05日	2022年07月11日	33.80	28,800	973,440.00
2	600256	广汇能源	2022年07月04日	2022年07月04日	10.54	83,200	876,928.00
3	600096	云天化	2022年07月11日	2022年07月11日	31.48	21,200	667,376.00
4	603077	和邦生物	2022年07月11日	2022年07月11日	4.26	119,400	508,644.00
5	002385	大北农	2022年07月11日	2022年07月11日	7.81	64,000	499,840.00
6	600499	科	2022	2022	20.64	23,900	493,296.00

		达制造	年 07 月 04 日	年 07 月 04 日				
7	000519	中兵红箭	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	29.15	16,100	469,315.00
8	601058	赛轮轮胎	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	11.27	41,400	466,578.00
9	000630	铜陵有色	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	3.26	142,300	463,898.00
10	002268	卫士通	2022 年 07 月 04 日	-	2022 年 07 月 04 日	42.91	10,700	459,137.00
11	000988	华工科技	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	23.17	19,400	449,498.00
12	002353	杰瑞股份	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	40.30	11,100	447,330.00
13	688099	晶晨股份	2022 年 07 月 04 日	-	2022 年 07 月 04 日	101.00	4,400	444,400.00
14	002056	横店东磁	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	26.62	15,700	417,934.00
15	000983	山西焦煤	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	13.39	30,000	401,700.00
16	601696	中银证券	2022 年 07 月 04 日	-	2022 年 07 月 04 日	13.30	30,100	400,330.00
17	688777	中	2022	-	2022	72.76	5,400	392,904.00

		控 技 术	年 07 月 11 日	-	年 07 月 11 日			
18	002028	思 源 电 气	2022 年 07 月 04 日	-	2022 年 07 月 04 日	35.66	11,000	392,260.00
19	002603	以 岭 药 业	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	24.30	16,100	391,230.00
20	002797	第 一 创 业	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	6.41	60,900	390,369.00
21	601872	招 商 轮 船	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	5.76	62,600	360,576.00
22	000970	中 科 三 环	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	18.78	18,900	354,942.00
23	000831	五 矿 稀 土	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	31.25	11,300	353,125.00
24	688390	固 德 威	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	313.01	1,100	344,311.00
25	600516	方 大 炭 素	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	7.60	44,100	335,160.00
26	000807	云 铝 股 份	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	9.88	33,500	330,980.00
27	300699	光 威 复 材	2022 年 07 月 04 日	-	2022 年 07 月 11 日	58.87	5,600	329,672.00
28	300088	长	2022	-	2022	7.42	44,400	329,448.00

		信 科 技	年 07 月 11 日	年 07 月 11 日			
29	000039	中 集 集 团	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	13.85	23,700	328,245.00
30	002624	完 美 世 界	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	14.37	22,400	321,888.00
31	300058	蓝 色 光 标	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	6.53	48,100	314,093.00
32	600143	金 发 科 技	2022 年 07 月 04 日	- 2022 年 07 月 04 日	9.52	32,500	309,400.00
33	002422	科 伦 药 业	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	18.70	16,500	308,550.00
34	601997	贵 阳 银 行	2022 年 07 月 04 日	- 2022 年 07 月 04 日	5.81	52,900	307,349.00
35	600482	中 国 动 力	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	15.71	19,500	306,345.00
36	002273	水 晶 光 电	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	12.11	25,200	305,172.00
37	600079	人 福 医 药	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	16.00	18,900	302,400.00
38	000636	风 华 高 科	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	18.79	15,600	293,124.00
39	002092	中	2022	- 2022	7.76	37,200	288,672.00

		泰化学	年 07 月 04 日	年 07 月 04 日			
40	002439	启明星辰	2022 年 07 月 04 日	- 2022 年 07 月 04 日	19.93	14,400	286,992.00
41	689009	九号公司	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	44.50	6,400	284,800.00
42	600985	淮北矿业	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	14.56	19,200	279,552.00
43	601016	节能风电	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	4.80	58,100	278,880.00
44	000887	中鼎股份	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	18.24	15,200	277,248.00
45	002372	伟星新材	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	24.04	11,500	276,460.00
46	600026	中远海能	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	10.33	26,700	275,811.00
47	002506	协鑫集成	2022 年 07 月 04 日	- 2022 年 07 月 04 日	3.72	74,100	275,652.00
48	600372	中航电子	2022 年 07 月 04 日	- 2022 年 07 月 04 日	19.39	13,900	269,521.00
49	300026	红日药业	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	7.70	34,800	267,960.00
50	600258	首	2022	- 2022	24.80	10,800	267,840.00

		旅 酒 店	年 07 月 11 日	年 07 月 11 日			
51	002203	海 亮 股 份	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	11.55	22,800	263,340.00
52	600171	上 海 贝 岭	2022 年 07 月 04 日	- 2022 年 07 月 04 日	25.03	10,300	257,809.00
53	600801	华 新 水 泥	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	19.51	13,100	255,581.00
54	600418	江 淮 汽 车	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	17.16	14,700	252,252.00
55	600166	福 田 汽 车	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	2.83	88,900	251,587.00
56	300383	光 环 新 网	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	10.42	24,000	250,080.00
57	002195	二 三 四 五	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	2.25	110,500	248,625.00
58	600820	隧 道 股 份	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	6.12	39,800	243,576.00
59	601636	旗 滨 集 团	2022 年 07 月 04 日	- 2022 年 07 月 04 日	12.75	19,100	243,525.00
60	601717	郑 煤 机	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	14.41	16,700	240,647.00
61	600875	东	2022	- 2022	16.45	14,500	238,525.00

		方 电 气	年 07 月 11 日	-	年 07 月 11 日			
62	300017	网 宿 科 技	2022 年 07 月 04 日	-	2022 年 07 月 11 日	5.36	44,400	237,984.00
63	002373	千 方 科 技	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	11.12	21,300	236,856.00
64	002078	太 阳 纸 业	2022 年 07 月 04 日	-	2022 年 07 月 04 日	12.31	19,200	236,352.00
65	000739	普 洛 药 业	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	20.64	11,400	235,296.00
66	000027	深 圳 能 源	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	6.41	36,700	235,247.00
67	002065	东 华 软 件	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	6.32	37,100	234,472.00
68	688256	寒 武 纪	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	64.70	3,600	232,920.00
69	002212	天 融 信	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	10.15	22,800	231,420.00
70	601866	中 远 海 发	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	3.00	76,500	229,500.00
71	600392	盛 和 资 源	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	22.60	10,000	226,000.00
72	000400	许	2022	-	2022	19.20	11,700	224,640.00

		继 电 气	年 07 月 11 日	年 07 月 11 日			
73	002408	齐 翔 腾 达	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	8.11	27,100	219,781.00
74	300182	捷 成 股 份	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	5.50	39,800	218,900.00
75	300070	碧 水 源	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	5.21	42,000	218,820.00
76	002183	怡 亚 通	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	7.21	30,100	217,021.00
77	300168	万 达 信 息	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	9.44	22,900	216,176.00
78	600998	九 州 通	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	11.91	18,100	215,571.00
79	600208	新 湖 中 宝	2022 年 07 月 04 日	- 2022 年 07 月 04 日	2.76	78,000	215,280.00
80	600863	内 蒙 华 电	2022 年 07 月 04 日	- 2022 年 07 月 04 日	3.65	58,900	214,985.00
81	600118	中 国 卫 星	2022 年 07 月 04 日	- 2022 年 07 月 04 日	20.08	10,700	214,856.00
82	000060	中 金 岭 南	2022 年 07 月 04 日	- 2022 年 07 月 04 日	4.46	47,400	211,404.00
83	000997	新	2022	- 2022	13.21	15,900	210,039.00

		大陆	年 07 月 11 日	年 07 月 11 日			
84	002505	鹏都农牧	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	3.39	61,500	208,485.00
85	300024	机器人	2022 年 07 月 04 日	- 2022 年 07 月 11 日	10.08	20,500	206,640.00
86	600839	四川长虹	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	2.88	71,300	205,344.00
87	603885	吉祥航空	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	17.99	11,400	205,086.00
88	600297	广汇汽车	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	2.61	78,300	204,363.00
89	002670	国盛金控	2022 年 06 月 06 日	- 2022 年 06 月 06 日	9.60	21,100	202,560.00
90	002127	南极电商	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	5.34	37,900	202,386.00
91	002625	光启技术	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	17.27	11,700	202,059.00
92	002191	劲嘉股份	2022 年 07 月 04 日	- 2022 年 07 月 04 日	10.72	18,700	200,464.00
93	002128	电投能源	2022 年 07 月 04 日	- 2022 年 07 月 04 日	14.32	13,900	199,048.00
94	600970	中	2022	- 2022	9.69	20,500	198,645.00

		材 国 际	年 07 月 11 日	-	年 07 月 11 日			
95	600667	太 极 实 业	2022 年 07 月 04 日	-	2022 年 07 月 04 日	7.38	26,700	197,046.00
96	002155	湖 南 黄 金	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	12.14	16,200	196,668.00
97	000012	南 玻 A	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	7.42	26,500	196,630.00
98	600409	三 友 化 工	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	8.19	23,900	195,741.00
99	300482	万 孚 生 物	2022 年 07 月 04 日	-	2022 年 07 月 11 日	40.71	4,800	195,408.00
100	002244	滨 江 集 团	2022 年 07 月 04 日	-	2022 年 07 月 04 日	8.65	22,500	194,625.00
101	600060	海 信 视 像	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	12.50	15,100	188,750.00
102	300677	英 科 医 疗	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	25.36	7,400	187,664.00
103	002266	浙 富 控 股	2022 年 07 月 04 日	-	2022 年 07 月 04 日	4.79	39,000	186,810.00
104	600155	华 创 阳 安	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	8.48	22,000	186,560.00
105	300308	中	2022	-	2022	31.05	6,000	186,300.00

		际旭创	年 07 月 04 日	年 07 月 11 日			
106	601880	辽港股份	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	1.70	109,100	185,470.00
107	000709	河钢股份	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	2.26	82,000	185,320.00
108	000690	宝新能源	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	4.38	42,000	183,960.00
109	002939	长城证券	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	10.16	17,900	181,864.00
110	002153	石基信息	2022 年 07 月 04 日	- 2022 年 07 月 04 日	15.87	11,400	180,918.00
111	000598	兴蓉环境	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	5.11	34,600	176,806.00
112	000656	金科股份	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	2.86	61,800	176,748.00
113	600728	佳都科技	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	6.46	27,100	175,066.00
114	600808	马钢股份	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	3.79	46,100	174,719.00
115	600567	山鹰国际	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	2.77	62,300	172,571.00
116	603225	新	2022	- 2022	11.54	14,700	169,638.00

		凤鸣	年 07 月 11 日	年 07 月 11 日				
117	002745	木林森	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	9.77	17,200	168,044.00
118	300115	长盈精密	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	10.31	16,200	167,022.00
119	600037	歌华有线	2022 年 07 月 04 日	-	2022 年 07 月 04 日	9.39	17,700	166,203.00
120	601958	金钼股份	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	8.84	18,700	165,308.00
121	601106	中国一重	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	3.07	53,000	162,710.00
122	300463	迈克生物	2022 年 07 月 04 日	-	2022 年 07 月 04 日	20.49	7,800	159,822.00
123	601456	国联证券	2022 年 07 月 04 日	-	2022 年 07 月 04 日	12.27	12,900	158,283.00
124	601718	际华集团	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	3.10	50,900	157,790.00
125	688289	圣湘生物	2022 年 07 月 04 日	-	2022 年 07 月 11 日	29.61	5,300	156,933.00
126	000540	中天金融	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	1.93	81,200	156,716.00
127	600021	上	2022	-	2022	10.25	15,100	154,775.00

		海 电 力	年 07 月 11 日	年 07 月 11 日			
128	300166	东 方 国 信	2022 年 07 月 04 日	- 2022 年 07 月 11 日	9.22	16,700	153,974.00
129	300888	稳 健 医 疗	2022 年 07 月 04 日	- 2022 年 07 月 11 日	66.50	2,300	152,950.00
130	600056	中 国 医 药	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	14.82	10,300	152,646.00
131	002390	信 邦 制 药	2022 年 07 月 04 日	- 2022 年 07 月 04 日	6.91	22,000	152,020.00
132	601860	紫 金 银 行	2022 年 07 月 04 日	- 2022 年 07 月 04 日	2.87	52,800	151,536.00
133	000987	越 秀 金 控	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	7.03	21,500	151,145.00
134	300072	三 聚 环 保	2022 年 07 月 01 日	- 2022 年 07 月 11 日	5.06	29,600	149,776.00
135	600435	北 方 导 航	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	8.62	17,200	148,264.00
136	000089	深 圳 机 场	2022 年 07 月 04 日	- 2022 年 07 月 04 日	7.72	18,600	143,592.00
137	002468	申 通 快 递	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	11.92	11,800	140,656.00
138	000537	广	2022	- 2022	12.99	10,800	140,292.00

		宇发展	年 07 月 11 日	-	年 07 月 11 日			
139	600871	石化油服	2022 年 07 月 04 日	-	2022 年 07 月 11 日	1.89	73,900	139,671.00
140	300012	华测检测	2022 年 07 月 04 日	-	2022 年 07 月 11 日	23.21	6,000	139,260.00
141	600120	浙江东方	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	4.01	33,500	134,335.00
142	002429	兆驰股份	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	3.84	34,900	134,016.00
143	000488	晨鸣纸业	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	5.64	23,600	133,104.00
144	002416	爱施德	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	9.30	14,300	132,990.00
145	002233	塔牌集团	2022 年 07 月 04 日	-	2022 年 07 月 04 日	8.85	15,000	132,750.00
146	000990	诚志股份	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	10.95	12,100	132,495.00
147	600167	联美控股	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	7.49	17,600	131,824.00
148	000685	中山公用	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	7.68	17,100	131,328.00
149	600446	金	2022	-	2022	10.38	12,600	130,788.00

		证 股 份	年 07 月 11 日	年 07 月 11 日			
150	002081	金 螳 螂	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	5.08	25,700	130,556.00
151	002382	蓝 帆 医 疗	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	9.55	13,600	129,880.00
152	600373	中 文 传 媒	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	9.99	13,000	129,870.00
153	600707	彩 虹 股 份	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	4.68	27,700	129,636.00
154	000158	常 山 北 明	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	6.00	21,600	129,600.00
155	002174	游 族 网 络	2022 年 07 月 04 日	- 2022 年 07 月 04 日	9.77	13,200	128,964.00
156	601611	中 国 核 建	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	8.39	15,300	128,367.00
157	600811	东 方 集 团	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	2.83	45,000	127,350.00
158	300212	易 华 录	2022 年 07 月 04 日	- 2022 年 07 月 11 日	17.40	7,200	125,280.00
159	000528	柳 工	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	6.51	18,800	122,388.00
160	000563	陕	2022	- 2022	3.12	38,200	119,184.00

		国投 A	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日			
161	600398	海澜之家	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	4.75	25,000	118,750.00
162	601598	中国外运	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	3.88	30,400	117,952.00
163	600006	东风汽车	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	7.55	15,400	116,270.00
164	600500	中化国际	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	6.65	17,300	115,045.00
165	300257	开山股份	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	14.96	7,600	113,696.00
166	688029	南微医学	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	87.20	1,300	113,360.00
167	000961	中南建设	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	3.05	36,900	112,545.00
168	600717	天津港	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	4.01	27,900	111,879.00
169	002434	万里扬	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	8.55	12,900	110,295.00
170	000718	苏宁环球	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	3.68	29,300	107,824.00
171	002387	维	2022	-	2022	6.72	16,000	107,520.00

		信 诺	年 07 月 11 日	-	年 07 月 11 日			
172	000031	大悦城	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	4.00	24,800	99,200.00
173	600787	中储股份	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	5.69	17,000	96,730.00
174	000883	湖北能源	2022 年 07 月 04 日	-	2022 年 07 月 04 日	5.11	18,700	95,557.00
175	600968	海油发展	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	2.58	36,600	94,428.00
176	600928	西安银行	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	3.67	25,700	94,319.00
177	601969	海南矿业	2022 年 07 月 04 日	-	2022 年 07 月 04 日	8.59	10,900	93,631.00
178	600339	中油工程	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	2.89	32,300	93,347.00
179	002563	森马服饰	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	5.92	15,600	92,352.00
180	601228	广州港	2022 年 07 月 04 日	-	2022 年 07 月 11 日	3.67	22,300	81,841.00
181	601139	深圳燃气	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	6.94	11,100	77,034.00
182	600027	华	2022	-	2022	3.93	19,500	76,635.00

		电 国 际	年 07 月 11 日	年 07 月 11 日			
183	000717	韶 钢 松 山	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	3.50	21,700	75,950.00
184	600755	厦 门 国 贸	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	7.50	10,000	75,000.00
185	600901	江 苏 租 赁	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	5.13	14,200	72,846.00
186	300869	康 泰 医 学	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	28.26	2,300	64,998.00
187	002249	大 洋 电 机	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	6.14	10,000	61,400.00
188	600008	首 创 环 保	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	2.90	10,000	29,000.00
合计	-	-	-	-	-	5,252,300	42,063,501.00

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

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息,导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券,且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券,不得超过该证券的 10%。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行,申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外,在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算,因此违约风险发生的可能性很小;基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估,以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本报告期内,本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本 期 末 202 2 年 06 月 30 日	1 个月以内	1- 3 个月	3 个月-1 年	1- 5 年	5 年 以上	不计息	合计
资产							
银行存款	21,195,895.69	-	-	-	-	-	21,195,895.69
结算备付金	7,666,292.90	-	-	-	-	-	7,666,292.90
存出保证金	48,839.63	-	-	-	-	1,221,888.00	1,270,727.63
交易性金融资产	-	-	1,653,949.90	-	-	397,661,821.62	399,315,771.52
衍	-	-	-	-	-	-	-

生金融资产							
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	74,113.30	74,113.30
应收申购款	229,610.86	-	-	-	-	2,718,574.46	2,948,185.32
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	11,040.52	11,040.52
资产	29,140,639.08	-	1,653,949.90	-	-	401,687,437.90	432,482,026.88

总计							
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	0.42	0.42
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,819,287.50	1,819,287.50
应付管理	-	-	-	-	-	171,078.99	171,078.99

人 报 酬							
应付 托 管 费	-	-	-	-	-	34,215.79	34,215.79
应付 销 售 服 务 费	-	-	-	-	-	28,834.14	28,834.14
应付 投 资 顾 问 费	-	-	-	-	-	-	-
应 交 税 费	-	-	-	-	-	1,445.62	1,445.62
应 付 利 润	-	-	-	-	-	-	-
递 延 所 得 税 负 债	-	-	-	-	-	-	-
其 他 负 债	-	-	-	-	-	302,425.00	302,425.00
负 债 总	-	-	-	-	-	2,357,287.46	2,357,287.46

计							
利率 敏 感 度 缺 口	29,140,639.0 8	-	1,653,949.9 0	-	-	399,330,150.4 4	430,124,739.4 2
上 年 度 末 202 1 年 12 月 31 日	1 个月以内	1- 3 个 月	3 个月-1 年	1- 5 年	5 年 以 上	不计息	合计
资 产							
银 行 存 款	23,719,024.8 9	-	-	-	-	-	23,719,024.89
结 算 备 付 金	8,101,772.97	-	-	-	-	-	8,101,772.97
存 出 保 证 金	65,490.48	-	-	-	-	1,601,107.20	1,666,597.68
交 易 性 金 融 资 产	-	-	138,547.20	-	-	371,126,184.4 9	371,264,731.6 9
衍 生 金	-	-	-	-	-	-	-

融资产							
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	186,673.78	-	-	-	-	1,964,690.78	2,151,364.56
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	20,747.72	20,747.72
资产总计	32,072,962.12	-	138,547.20	-	-	374,712,730.19	406,924,239.51

负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,184,614.79	2,184,614.79
应付管理人报	-	-	-	-	-	167,256.94	167,256.94

酬							
应付托管费	-	-	-	-	-	33,451.36	33,451.36
应付销售服务费	-	-	-	-	-	28,730.40	28,730.40
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	47,920.79	47,920.79
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	353,783.72	353,783.72
负债总计	-	-	-	-	-	2,815,758.00	2,815,758.00
利	32,072,962.1	-	138,547.20	-	-	371,896,972.1	404,108,481.5

率 敏 感 度 缺 口	2					9	1
----------------------------	---	--	--	--	--	---	---

上表统计了本基金资产和负债的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；		
	2. 该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；		
	3. 该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；		
	4. 银行活期存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；定期存款利息收入、买入返售金融资产利息收益与卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响；		
	5. 该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券和可交换债券。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022 年 06 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	基准利率减少 25 个基点	2,010.44	83.96
基准利率增加 25 个基点	-2,005.07	-83.84	

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场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的股票、债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且

本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 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	397,661,821.62	92.45	371,126,184.49	91.84
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,653,949.90	0.38	138,547.20	0.03
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	399,315,771.52	92.84	371,264,731.69	91.87

本基金的股票资产及存托凭证投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；		
	2. 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022 年 06 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	中证 500 指数 上涨 5%	20,106,016.21	19,072,019.74
	中证 500 指数 下跌 5%	-20,106,016.21	-19,072,019.74

本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、

可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 06 月 30 日
第一层次	396,435,127.67
第二层次	2,264,061.05
第三层次	616,582.80
合计	399,315,771.52

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额 (元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	397,661,821.62	91.95
	其中：股票	397,661,821.62	91.95
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,653,949.90	0.38
	其中：债券	1,653,949.90	0.38
	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	28,862,188.59	6.67
8	其他各项资产	4,304,066.77	1.00
9	合计	432,482,026.88	100.00

注：本基金参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为人民币 42,063,501.00 元，占期末基金资产净值比例 9.78%。

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	3,651,082.00	0.85
B	采矿业	17,696,361.72	4.11
C	制造业	237,358,010.31	55.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,145,611.80	2.36
E	建筑业	5,146,284.00	1.20
F	批发和零售业	14,453,779.17	3.36
G	交通运输、仓储和邮政业	10,620,719.46	2.47
H	住宿和餐饮业	840,720.00	0.20
I	信息传输、软件和信息技术服务业	29,697,379.77	6.90
J	金融业	35,272,695.56	8.20
K	房地产业	8,684,347.00	2.02
L	租赁和商务服务业	4,531,165.00	1.05
M	科学研究和技术服务业	4,971,420.00	1.16
N	水利、环境和公共设施管理业	2,891,010.59	0.67

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	929,921.10	0.22
R	文化、体育和娱乐业	5,329,294.00	1.24
S	综合	2,918,123.60	0.68
	合计	395,137,925.08	91.87

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	2,414,320.90	0.56
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	39,787.97	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	11,796.23	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	23,109.86	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	13,480.42	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,523,896.54	0.59

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位:人民币元

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

1	600522	中天科技	164,800	3,806,880.00	0.89
2	601615	明阳智能	101,600	3,434,080.00	0.80
3	600256	广汇能源	277,500	2,924,850.00	0.68
4	300769	德方纳米	6,900	2,819,892.00	0.66
5	600096	云天化	77,600	2,442,848.00	0.57
6	300012	华测检测	101,500	2,355,815.00	0.55
7	002497	雅化集团	69,700	2,275,705.00	0.53
8	002407	多氟多	46,300	2,264,533.00	0.53
9	002240	盛新锂能	36,600	2,209,176.00	0.51
10	300390	天华超净	24,800	2,167,520.00	0.50
11	002180	纳思达	42,800	2,166,536.00	0.50
12	600885	宏发股份	50,318	2,105,808.30	0.49
13	000009	中国宝安	155,740	2,100,932.60	0.49
14	600141	兴发集团	47,040	2,069,289.60	0.48
15	300073	当升科技	21,500	1,942,310.00	0.45
16	600392	盛和资源	84,760	1,915,576.00	0.45
17	002384	东山精密	82,600	1,894,018.00	0.44
18	002756	永兴材料	12,300	1,872,183.00	0.44
19	603613	国联股份	21,120	1,871,232.00	0.44
20	600418	江淮汽车	105,500	1,810,380.00	0.42
21	300285	国瓷材料	48,500	1,742,120.00	0.41
22	600765	中航重机	53,320	1,715,837.60	0.40
23	600399	抚顺特钢	95,200	1,704,080.00	0.40

24	600233	圆通速递	83,100	1,694,409.00	0.39
25	600563	法拉电子	8,201	1,682,517.16	0.39
26	601555	东吴证券	242,090	1,677,683.70	0.39
27	601058	赛轮轮胎	147,800	1,665,706.00	0.39
28	600487	亨通光电	114,200	1,660,468.00	0.39
29	000983	山西焦煤	123,700	1,656,343.00	0.39
30	300037	新宙邦	31,460	1,653,537.60	0.38
31	600499	科达制造	79,800	1,647,072.00	0.38
32	600732	爱旭股份	49,200	1,624,584.00	0.38
33	603077	和邦生物	373,200	1,589,832.00	0.37
34	688180	君实生物	20,900	1,574,606.00	0.37
35	603456	九洲药业	30,300	1,566,510.00	0.36
36	002385	大北农	200,000	1,562,000.00	0.36
37	688122	西部超导	16,900	1,558,180.00	0.36
38	300363	博腾股份	19,800	1,544,202.00	0.36
39	601108	财通证券	195,950	1,542,126.50	0.36
40	002268	卫士通	35,830	1,537,465.30	0.36
41	688099	晶晨股份	14,939	1,508,839.00	0.35
42	600486	扬农化工	11,300	1,506,064.00	0.35
43	603345	安井食品	8,800	1,477,256.00	0.34
44	600298	安琪酵母	30,200	1,472,250.00	0.34
45	000519	中兵红箭	50,400	1,469,160.00	0.34
46	300144	宋城演	94,900	1,456,715.00	0.34

		艺			
47	000630	铜陵有色	444,500	1,449,070.00	0.34
48	600862	中航高科	50,501	1,419,078.10	0.33
49	000988	华工科技	60,700	1,406,419.00	0.33
50	603605	珀莱雅	8,500	1,404,030.00	0.33
51	002353	杰瑞股份	34,741	1,400,062.30	0.33
52	000783	长江证券	233,400	1,384,062.00	0.32
53	601077	渝农商行	374,000	1,383,800.00	0.32
54	601168	西部矿业	115,100	1,361,633.00	0.32
55	002625	光启技术	78,000	1,347,060.00	0.31
56	601696	中银证券	100,500	1,336,650.00	0.31
57	300146	汤臣倍健	61,700	1,335,805.00	0.31
58	601162	天风证券	418,200	1,329,876.00	0.31
59	002028	思源电气	36,877	1,315,033.82	0.31
60	300724	捷佳伟创	14,700	1,313,445.00	0.31
61	688777	中控技术	18,000	1,309,680.00	0.30
62	002056	横店东磁	49,100	1,307,042.00	0.30
63	002797	第一创业	203,000	1,301,230.00	0.30
64	002507	涪陵榨菜	37,500	1,294,500.00	0.30
65	603517	绝味食品	22,300	1,289,386.00	0.30
66	600988	赤峰黄金	80,300	1,280,785.00	0.30
67	603589	口子窖	21,800	1,277,698.00	0.30
68	000932	华菱钢铁	250,280	1,273,925.20	0.30

69	002185	华天科技	135,200	1,268,176.00	0.29
70	601128	常熟银行	165,600	1,265,184.00	0.29
71	603026	石大胜华	8,600	1,250,010.00	0.29
72	601636	旗滨集团	97,200	1,239,300.00	0.29
73	600521	华海药业	54,300	1,232,610.00	0.29
74	605117	德业股份	4,400	1,231,516.00	0.29
75	688390	固德威	3,920	1,226,999.20	0.29
76	002603	以岭药业	50,460	1,226,178.00	0.29
77	600039	四川路桥	116,200	1,223,586.00	0.28
78	002326	永太科技	37,100	1,221,703.00	0.28
79	600109	国金证券	135,000	1,215,000.00	0.28
80	601607	上海医药	67,000	1,211,360.00	0.28
81	000830	鲁西化工	69,593	1,203,262.97	0.28
82	002078	太阳纸业	97,500	1,200,225.00	0.28
83	002624	完美世界	82,100	1,179,777.00	0.27
84	600153	建发股份	90,000	1,176,300.00	0.27
85	600546	山煤国际	60,000	1,167,600.00	0.27
86	603939	益丰药房	21,700	1,146,411.00	0.27
87	603267	鸿远电子	8,500	1,141,805.00	0.27
88	601872	招商轮船	195,800	1,127,808.00	0.26
89	002422	科伦药业	60,200	1,125,740.00	0.26
90	600348	华阳股份	72,800	1,125,488.00	0.26

91	600705	中航产融	323,600	1,119,656.00	0.26
92	600497	驰宏锌锗	215,000	1,115,850.00	0.26
93	000738	航发控制	39,700	1,115,570.00	0.26
94	601990	南京证券	133,600	1,114,224.00	0.26
95	600177	雅戈尔	167,900	1,113,177.00	0.26
96	000831	五矿稀土	35,600	1,112,500.00	0.26
97	600549	厦门钨业	51,400	1,111,268.00	0.26
98	300699	光威复材	18,800	1,106,756.00	0.26
99	600875	东方电气	67,200	1,105,440.00	0.26
100	603127	昭衍新药	9,700	1,103,860.00	0.26
101	000970	中科三环	58,650	1,101,447.00	0.26
102	300088	长信科技	148,300	1,100,386.00	0.26
103	300676	华大基因	15,000	1,075,500.00	0.25
104	600160	巨化股份	81,460	1,071,199.00	0.25
105	000999	华润三九	23,800	1,071,000.00	0.25
106	600859	王府井	41,002	1,065,231.96	0.25
107	002138	顺络电子	39,000	1,062,750.00	0.25
108	002572	索菲亚	38,600	1,061,500.00	0.25
109	000998	隆平高科	63,700	1,061,242.00	0.25
110	002673	西部证券	161,900	1,058,826.00	0.25
111	601699	潞安环能	72,400	1,058,488.00	0.25
112	600516	方大炭素	138,100	1,049,560.00	0.24
113	603444	吉比特	2,700	1,047,600.00	0.24
114	002557	洽洽食	18,400	1,047,512.00	0.24

		品			
115	000807	云铝股份	104,700	1,034,436.00	0.24
116	002508	老板电器	28,700	1,034,061.00	0.24
117	600143	金发科技	108,600	1,033,872.00	0.24
118	600482	中国动力	65,300	1,025,863.00	0.24
119	000039	中集集团	74,040	1,025,454.00	0.24
120	601997	贵阳银行	176,400	1,024,884.00	0.24
121	002030	达安基因	59,395	1,021,000.05	0.24
122	002273	水晶光电	84,081	1,018,220.91	0.24
123	000960	锡业股份	60,500	1,014,585.00	0.24
124	002465	海格通信	111,400	1,012,626.00	0.24
125	300357	我武生物	19,000	988,570.00	0.23
126	000629	攀钢钒钛	259,700	986,860.00	0.23
127	300136	信维通信	58,500	985,725.00	0.23
128	000728	国元证券	158,200	984,004.00	0.23
129	300058	蓝色光标	150,600	983,418.00	0.23
130	000975	银泰黄金	100,428	978,168.72	0.23
131	600170	上海建工	322,000	975,660.00	0.23
132	600536	中国软件	23,930	971,318.70	0.23
133	600704	物产中大	188,100	964,953.00	0.22
134	002092	中泰化学	124,300	964,568.00	0.22
135	601577	长沙银行	121,300	961,909.00	0.22

136	689009	九号公司	21,600	961,200.00	0.22
137	002439	启明星辰	48,200	960,626.00	0.22
138	002409	雅克科技	17,300	960,323.00	0.22
139	600079	人福医药	59,200	947,200.00	0.22
140	603198	迎驾贡酒	14,500	944,530.00	0.22
141	002294	信立泰	33,600	944,160.00	0.22
142	300474	景嘉微	13,750	940,362.50	0.22
143	002223	鱼跃医疗	36,300	931,458.00	0.22
144	300244	迪安诊断	29,901	929,921.10	0.22
145	300418	昆仑万维	58,000	928,000.00	0.22
146	002372	伟星新材	38,580	927,463.20	0.22
147	000547	航天发展	77,500	925,350.00	0.22
148	600415	小商品城	165,700	922,949.00	0.21
149	002739	万达电影	67,500	921,375.00	0.21
150	002506	协鑫集成	247,000	918,840.00	0.21
151	000636	风华高科	48,900	918,831.00	0.21
152	300558	贝达药业	15,100	918,080.00	0.21
153	300253	卫宁健康	103,900	912,242.00	0.21
154	600699	均胜电子	58,000	911,180.00	0.21
155	300308	中际旭创	29,100	903,555.00	0.21
156	600372	中航电子	46,500	901,635.00	0.21
157	300296	利亚德	123,100	898,630.00	0.21
158	600637	东方明珠	123,600	883,740.00	0.21

159	002683	广东宏大	31,700	882,211.00	0.21
160	600867	通化东宝	84,900	877,866.00	0.20
161	600315	上海家化	20,500	876,375.00	0.20
162	600985	淮北矿业	59,900	872,144.00	0.20
163	601016	节能风电	181,600	871,680.00	0.20
164	601198	东兴证券	97,700	869,530.00	0.20
165	600236	桂冠电力	142,700	869,043.00	0.20
166	000887	中鼎股份	47,600	868,224.00	0.20
167	600026	中远海能	84,000	867,720.00	0.20
168	002156	通富微电	56,200	865,480.00	0.20
169	002299	圣农发展	45,100	865,018.00	0.20
170	600171	上海贝岭	34,500	863,535.00	0.20
171	300832	新产业	19,000	857,090.00	0.20
172	002065	东华软件	135,600	856,992.00	0.20
173	600380	健康元	69,208	854,718.80	0.20
174	600879	航天电子	131,600	854,084.00	0.20
175	600642	申能股份	148,400	842,912.00	0.20
176	600258	首旅酒店	33,900	840,720.00	0.20
177	300026	红日药业	108,600	836,220.00	0.19
178	688185	康希诺	4,200	836,136.00	0.19
179	000750	国海证券	230,150	835,444.50	0.19
180	002936	郑州银行	310,559	835,403.71	0.19
181	002408	齐翔腾达	102,920	834,681.20	0.19

182	000623	吉林敖东	56,200	829,512.00	0.19
183	002203	海亮股份	71,400	824,670.00	0.19
184	000729	燕京啤酒	85,200	823,032.00	0.19
185	000513	丽珠集团	22,664	820,663.44	0.19
186	000400	许继电气	42,600	817,920.00	0.19
187	600673	东阳光	90,900	817,191.00	0.19
188	000878	云南铜业	71,700	816,663.00	0.19
189	600820	隧道股份	132,700	812,124.00	0.19
190	600801	华新水泥	41,300	805,763.00	0.19
191	600038	中直股份	17,800	804,560.00	0.19
192	600580	卧龙电驱	55,700	803,194.00	0.19
193	601717	郑煤机	55,700	802,637.00	0.19
194	600529	山东药玻	28,700	802,165.00	0.19
195	600369	西南证券	200,900	797,573.00	0.19
196	300017	网宿科技	148,100	793,816.00	0.18
197	300383	光环新网	75,900	790,878.00	0.18
198	002131	利欧股份	407,592	790,728.48	0.18
199	002183	怡亚通	109,600	790,216.00	0.18
200	603568	伟明环保	23,607	787,765.59	0.18
201	600316	洪都航空	26,001	786,270.24	0.18
202	600166	福田汽车	277,700	785,891.00	0.18
203	600848	上海临港	57,800	783,768.00	0.18
204	688256	寒武纪	12,100	782,870.00	0.18

205	002444	巨星科技	41,400	779,976.00	0.18
206	002958	青农商行	234,900	779,868.00	0.18
207	002195	二三四五	345,901	778,277.25	0.18
208	600909	华安证券	170,470	775,638.50	0.18
209	600325	华发股份	102,300	774,411.00	0.18
210	601005	重庆钢铁	405,000	773,550.00	0.18
211	600027	华电国际	196,400	771,852.00	0.18
212	600008	首创环保	265,340	769,486.00	0.18
213	300001	特锐德	43,901	759,926.31	0.18
214	300618	寒锐钴业	13,100	758,752.00	0.18
215	300024	机器人	75,000	756,000.00	0.18
216	000825	太钢不锈	137,500	749,375.00	0.17
217	002500	山西证券	130,110	746,831.40	0.17
218	002373	千方科技	67,000	745,040.00	0.17
219	002926	华西证券	95,000	744,800.00	0.17
220	002430	杭氧股份	23,800	743,988.00	0.17
221	688521	芯原股份	15,023	742,136.20	0.17
222	603218	日月股份	29,200	741,680.00	0.17
223	000050	深天马 A	74,300	740,771.00	0.17
224	000027	深圳能源	114,860	736,252.60	0.17
225	600271	航天信息	67,200	735,168.00	0.17
226	000739	普洛药业	35,600	734,784.00	0.17
227	002250	联化科	44,500	728,465.00	0.17

		技			
228	002212	天融信	71,600	726,740.00	0.17
229	603233	大参林	23,060	721,778.00	0.17
230	002670	国盛金控	74,898	719,020.80	0.17
231	600118	中国卫星	35,800	718,864.00	0.17
232	600208	新湖中宝	260,200	718,152.00	0.17
233	601866	中远海发	239,100	717,300.00	0.17
234	600863	内蒙华电	196,500	717,225.00	0.17
235	002985	北摩高科	12,110	709,403.80	0.16
236	300677	英科医疗	27,940	708,558.40	0.16
237	688009	中国通号	156,200	707,586.00	0.16
238	000060	中金岭南	158,300	706,018.00	0.16
239	300009	安科生物	69,276	700,380.36	0.16
240	002249	大洋电机	114,000	699,960.00	0.16
241	601992	金隅集团	252,200	698,594.00	0.16
242	002152	广电运通	75,100	696,177.00	0.16
243	000778	新兴铸管	144,300	695,526.00	0.16
244	600066	宇通客车	80,400	695,460.00	0.16
245	603156	养元饮品	30,600	695,232.00	0.16
246	603658	安图生物	14,200	694,238.00	0.16
247	300182	捷成股份	124,200	683,100.00	0.16
248	300070	碧水源	131,000	682,510.00	0.16
249	603858	步长制药	34,500	679,995.00	0.16
250	300168	万达信	71,700	676,848.00	0.16

		息			
251	002966	苏州银行	110,740	675,514.00	0.16
252	000401	冀东水泥	64,100	674,332.00	0.16
253	600998	九州通	56,600	674,106.00	0.16
254	300251	光线传媒	71,000	672,370.00	0.16
255	600056	中国医药	45,360	672,235.20	0.16
256	002191	劲嘉股份	62,400	668,928.00	0.16
257	002831	裕同科技	22,580	667,239.00	0.16
258	002128	电投能源	46,500	665,880.00	0.15
259	600390	五矿资本	135,800	664,062.00	0.15
260	600970	中材国际	68,500	663,765.00	0.15
261	000021	深科技	56,700	659,988.00	0.15
262	600667	太极实业	89,200	658,296.00	0.15
263	000997	新大陆	49,800	657,858.00	0.15
264	300482	万孚生物	16,090	655,023.90	0.15
265	002505	鹏都农牧	192,800	653,592.00	0.15
266	002221	东华能源	69,800	649,838.00	0.15
267	002244	滨江集团	75,000	648,750.00	0.15
268	600528	中铁工业	80,400	647,220.00	0.15
269	600021	上海电力	63,100	646,775.00	0.15
270	600062	华润双鹤	25,200	646,632.00	0.15
271	000656	金科股份	225,700	645,502.00	0.15
272	688002	睿创微纳	16,215	644,059.80	0.15

273	600839	四川长虹	222,600	641,088.00	0.15
274	002396	星网锐捷	28,300	640,712.00	0.15
275	000987	越秀金控	91,125	640,608.75	0.15
276	600827	百联股份	48,400	639,364.00	0.15
277	603885	吉祥航空	35,500	638,645.00	0.15
278	600297	广汇汽车	244,400	637,884.00	0.15
279	603707	健友股份	22,530	635,346.00	0.15
280	002127	南极电商	118,600	633,324.00	0.15
281	600598	北大荒	42,800	631,728.00	0.15
282	002019	亿帆医药	44,900	627,702.00	0.15
283	600155	华创阳安	73,600	624,128.00	0.15
284	600498	烽火通信	43,100	624,088.00	0.15
285	002266	浙富控股	130,100	623,179.00	0.14
286	600201	生物股份	67,978	622,678.48	0.14
287	002155	湖南黄金	51,000	619,140.00	0.14
288	600259	广晟有色	12,200	617,930.00	0.14
289	000012	南玻 A	82,865	614,858.30	0.14
290	600511	国药股份	22,902	613,315.56	0.14
291	000930	中粮科技	67,800	612,912.00	0.14
292	600409	三友化工	74,700	611,793.00	0.14
293	000883	湖北能源	119,300	609,623.00	0.14
294	002153	石基信息	38,160	605,599.20	0.14

295	600718	东软集团	52,400	603,124.00	0.14
296	600755	厦门国贸	79,900	599,250.00	0.14
297	002124	天邦食品	88,900	597,408.00	0.14
298	002511	中顺洁柔	47,479	594,437.08	0.14
299	000686	东北证券	85,000	594,150.00	0.14
300	600959	江苏有线	181,400	591,364.00	0.14
301	600060	海信视像	47,300	591,250.00	0.14
302	603712	七一二	18,700	589,050.00	0.14
303	688188	柏楚电子	2,660	585,306.40	0.14
304	000581	威孚高科	30,400	585,200.00	0.14
305	600282	南钢股份	185,600	584,640.00	0.14
306	600566	济川药业	21,500	583,940.00	0.14
307	600895	张江高科	46,800	582,660.00	0.14
308	600782	新钢股份	115,400	581,616.00	0.14
309	601880	辽港股份	342,000	581,400.00	0.14
310	601179	中国西电	124,100	580,788.00	0.14
311	000709	河钢股份	256,200	579,012.00	0.13
312	600064	南京高科	52,440	576,840.00	0.13
313	000690	宝新能源	131,500	575,970.00	0.13
314	600022	山东钢铁	330,500	575,070.00	0.13
315	002939	长城证券	56,200	570,992.00	0.13
316	600535	天士力	54,300	570,693.00	0.13
317	300376	易事特	69,700	565,964.00	0.13

318	601778	晶科科技	104,600	564,840.00	0.13
319	002701	奥瑞金	108,600	564,720.00	0.13
320	600216	浙江医药	40,900	558,285.00	0.13
321	300630	普利制药	15,875	558,006.25	0.13
322	002002	鸿达兴业	150,400	557,984.00	0.13
323	600037	歌华有线	59,000	554,010.00	0.13
324	000598	兴蓉环境	108,300	553,413.00	0.13
325	600500	中化国际	83,200	553,280.00	0.13
326	600808	马钢股份	145,800	552,582.00	0.13
327	002468	申通快递	46,300	551,896.00	0.13
328	600663	陆家嘴	53,100	550,116.00	0.13
329	002532	天山铝业	84,000	548,520.00	0.13
330	600728	佳都科技	84,700	547,162.00	0.13
331	002595	豪迈科技	24,300	542,862.00	0.13
332	600567	山鹰国际	195,400	541,258.00	0.13
333	688208	道通科技	16,410	540,217.20	0.13
334	600517	国网英大	103,400	536,646.00	0.12
335	603866	桃李面包	32,319	534,879.45	0.12
336	002004	华邦健康	95,700	534,006.00	0.12
337	300463	迈克生物	26,000	532,740.00	0.12
338	603225	新凤鸣	46,120	532,224.80	0.12
339	601456	国联证券	43,200	530,064.00	0.12
340	000785	居然之家	118,200	525,990.00	0.12

341	002745	木林森	53,800	525,626.00	0.12
342	688289	圣湘生物	17,744	525,399.84	0.12
343	002429	兆驰股份	136,700	524,928.00	0.12
344	600597	光明乳业	41,500	524,145.00	0.12
345	300115	长盈精密	50,820	523,954.20	0.12
346	688006	杭可科技	7,400	518,444.00	0.12
347	601958	金钼股份	58,600	518,024.00	0.12
348	300166	东方国信	55,893	515,333.46	0.12
349	300888	稳健医疗	7,700	512,050.00	0.12
350	002390	信邦制药	73,600	508,576.00	0.12
351	601106	中国一重	165,400	507,778.00	0.12
352	601860	紫金银行	176,100	505,407.00	0.12
353	603927	中科软	21,620	504,178.40	0.12
354	300072	三聚环保	98,900	500,434.00	0.12
355	600572	康恩贝	112,900	500,147.00	0.12
356	601118	海南橡胶	103,700	495,686.00	0.12
357	601718	际华集团	159,600	494,760.00	0.12
358	600398	海澜之家	104,100	494,475.00	0.11
359	600507	方大特钢	70,449	492,438.51	0.11
360	000540	中天金融	253,900	490,027.00	0.11
361	600737	中粮糖业	64,700	486,544.00	0.11
362	000089	深圳机场	62,100	479,412.00	0.11
363	603883	老百姓	14,147	479,300.36	0.11
364	002010	传化智	74,200	477,106.00	0.11

		联			
365	000937	冀中能源	63,900	476,694.00	0.11
366	600582	天地科技	99,700	476,566.00	0.11
367	000559	万向钱潮	80,100	475,794.00	0.11
368	002048	宁波华翔	29,600	474,192.00	0.11
369	002368	太极股份	24,502	470,683.42	0.11
370	600967	内蒙一机	51,600	470,592.00	0.11
371	600435	北方导航	54,100	466,342.00	0.11
372	600871	石化油服	246,600	466,074.00	0.11
373	000898	鞍钢股份	144,600	465,612.00	0.11
374	002690	美亚光电	21,430	464,602.40	0.11
375	601000	唐山港	178,330	460,091.40	0.11
376	001914	招商积余	25,600	460,032.00	0.11
377	601568	北元集团	71,790	455,148.60	0.11
378	600195	中牧股份	36,949	452,994.74	0.11
379	002110	三钢闽光	73,950	450,355.50	0.10
380	000959	首钢股份	94,400	449,344.00	0.10
381	600556	天下秀	54,500	448,535.00	0.10
382	000156	华数传媒	56,000	446,320.00	0.10
383	601333	广深铁路	204,400	445,592.00	0.10
384	002281	光迅科技	25,305	444,861.90	0.10
385	002233	塔牌集团	50,201	444,278.85	0.10
386	688321	微芯生物	17,428	439,011.32	0.10

387	600811	东方集团	154,700	437,801.00	0.10
388	000537	广宇发展	33,700	437,763.00	0.10
389	002705	新宝股份	19,900	437,601.00	0.10
390	003035	南网能源	68,700	436,245.00	0.10
391	600764	中国海防	17,200	434,128.00	0.10
392	002174	游族网络	44,100	430,857.00	0.10
393	000402	金融街	72,400	430,780.00	0.10
394	600329	达仁堂	17,300	425,234.00	0.10
395	600120	浙江东方	105,470	422,934.70	0.10
396	300212	易华录	24,180	420,732.00	0.10
397	600126	杭钢股份	81,720	418,406.40	0.10
398	000488	晨鸣纸业	74,000	417,360.00	0.10
399	603638	艾迪精密	20,320	416,560.00	0.10
400	002416	爱施德	44,781	416,463.30	0.10
401	600167	联美控股	55,480	415,545.20	0.10
402	000990	诚志股份	37,900	415,005.00	0.10
403	600446	金证股份	39,800	413,124.00	0.10
404	000685	中山公用	53,600	411,648.00	0.10
405	601200	上海环境	40,450	410,972.00	0.10
405	002081	金螳螂	80,900	410,972.00	0.10
407	601098	中南传媒	43,500	410,640.00	0.10
408	600373	中文传媒	41,100	410,589.00	0.10
409	002867	周大生	26,400	409,992.00	0.10
410	002925	盈趣科	18,980	408,449.60	0.09

		技			
411	600707	彩虹股份	86,600	405,288.00	0.09
412	002382	蓝帆医疗	42,400	404,920.00	0.09
413	000158	常山北明	67,400	404,400.00	0.09
414	688029	南微医学	4,620	402,864.00	0.09
415	601611	中国核建	47,900	401,881.00	0.09
416	600095	湘财股份	51,900	399,111.00	0.09
417	002399	海普瑞	22,700	399,066.00	0.09
418	001965	招商公路	52,200	398,286.00	0.09
419	603317	天味食品	13,940	396,871.80	0.09
420	601608	中信重工	104,600	396,434.00	0.09
421	002387	维信诺	58,200	391,104.00	0.09
422	688088	虹软科技	12,344	389,946.96	0.09
423	600131	国网信通	28,800	387,360.00	0.09
424	000967	盈峰环境	76,400	386,584.00	0.09
425	000528	柳工	59,260	385,782.60	0.09
426	002948	青岛银行	106,530	385,638.60	0.09
427	600376	首开股份	78,000	382,980.00	0.09
428	601187	厦门银行	64,000	381,440.00	0.09
429	600623	华谊集团	45,800	380,140.00	0.09
430	603000	人民网	33,300	372,960.00	0.09
431	000563	陕国投 A	119,220	371,966.40	0.09
432	002423	中粮资本	55,400	371,734.00	0.09
433	601598	中国外	95,500	370,540.00	0.09

		运			
434	600901	江苏租赁	72,100	369,873.00	0.09
435	600307	酒钢宏兴	189,400	367,436.00	0.09
436	601991	大唐发电	150,200	364,986.00	0.08
437	600006	东风汽车	48,300	364,665.00	0.08
438	603228	景旺电子	15,501	361,638.33	0.08
439	300257	开山股份	24,101	360,550.96	0.08
440	603650	彤程新材	10,900	355,122.00	0.08
441	600906	财达证券	39,300	353,307.00	0.08
442	000961	中南建设	115,400	351,970.00	0.08
443	600717	天津港	87,363	350,325.63	0.08
444	002242	九阳股份	18,601	341,514.36	0.08
445	000718	苏宁环球	92,000	338,560.00	0.08
446	002434	万里扬	39,500	337,725.00	0.08
447	601928	凤凰传媒	45,900	328,185.00	0.08
448	000553	安道麦 A	26,300	318,493.00	0.07
449	600968	海油发展	122,200	315,276.00	0.07
450	601969	海南矿业	36,600	314,394.00	0.07
451	000031	大悦城	77,200	308,800.00	0.07
452	600648	外高桥	22,700	308,720.00	0.07
453	600787	中储股份	53,200	302,708.00	0.07
454	600928	西安银行	80,200	294,334.00	0.07
455	600339	中油工程	101,100	292,179.00	0.07
456	002563	森马服饰	49,100	290,672.00	0.07
457	601228	广州港	74,400	273,048.00	0.06

458	002815	崇达技术	21,300	272,853.00	0.06
459	300869	康泰医学	9,600	271,296.00	0.06
460	000028	国药一致	9,101	271,118.79	0.06
461	600835	上海机电	19,504	267,789.92	0.06
462	688819	天能股份	7,600	262,808.00	0.06
463	600377	宁沪高速	30,100	257,957.00	0.06
464	000717	韶钢松山	72,600	254,100.00	0.06
465	002945	华林证券	16,400	250,100.00	0.06
466	603056	德邦股份	18,601	249,811.43	0.06
467	603379	三美股份	11,100	246,975.00	0.06
468	000869	张裕 A	8,200	243,868.00	0.06
469	601139	深圳燃气	35,000	242,900.00	0.06
470	000062	深圳华强	19,040	241,808.00	0.06
471	600299	安迪苏	24,300	232,794.00	0.05
472	601298	青岛港	42,000	229,740.00	0.05
473	601869	长飞光纤	7,400	228,808.00	0.05
474	603868	飞科电器	2,900	219,675.00	0.05
475	001872	招商港口	13,700	213,720.00	0.05
476	601156	东航物流	10,700	211,860.00	0.05
477	002653	海思科	13,100	211,041.00	0.05
478	300741	华宝股份	7,400	205,868.00	0.05
479	600823	世茂股份	68,200	203,236.00	0.05
480	600350	山东高速	37,800	198,450.00	0.05

481	601828	美凯龙	32,700	198,162.00	0.05
482	600927	永安期货	9,600	193,632.00	0.05
483	001227	兰州银行	37,500	184,500.00	0.04
484	603355	莱克电气	7,042	177,669.66	0.04
485	603786	科博达	2,700	166,239.00	0.04
486	603515	欧普照明	9,250	161,412.50	0.04
487	001203	大中矿业	13,700	154,810.00	0.04
488	601665	齐鲁银行	30,600	149,328.00	0.03
489	603719	良品铺子	5,000	143,150.00	0.03
490	002946	新乳业	10,700	138,993.00	0.03
491	601003	柳钢股份	30,900	125,145.00	0.03
492	002901	大博医疗	2,800	109,592.00	0.03
493	600956	新天绿能	8,633	106,358.56	0.02
494	603983	丸美股份	3,200	85,760.00	0.02
495	600917	重庆燃气	10,402	75,102.44	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	002013	中航机电	125,600	1,551,160.00	0.36
2	688295	中复神鹰	5,549	190,996.58	0.04
3	688209	英集芯	6,822	188,150.76	0.04
4	688167	炬光科技	978	145,477.50	0.03
5	688150	莱特光	5,626	125,122.24	0.03

		电			
6	688553	汇宇制药	2,499	60,700.71	0.01
7	301069	凯盛新材	539	24,853.29	0.01
8	301263	泰恩康	682	21,401.16	0.00
9	301187	欧圣电气	876	19,745.04	0.00
10	301162	国能日新	334	18,072.74	0.00
11	301201	诚达药业	242	17,312.68	0.00
12	301268	铭利达	435	15,168.45	0.00
13	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
14	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.00
15	301103	何氏眼科	421	13,480.42	0.00
16	301109	军信股份	764	12,330.96	0.00
17	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
18	301235	华康医疗	311	11,796.23	0.00
19	301200	大族数控	223	11,578.16	0.00
20	301148	嘉戎技术	451	10,778.90	0.00
21	301207	华兰疫苗	168	9,478.56	0.00
22	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
23	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
24	301110	青木股份	187	7,451.95	0.00
25	300834	星辉环材	216	6,486.48	0.00
26	301196	唯科科技	152	5,703.04	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	2,497,314.00	0.62
2	300012	华测检测	2,446,035.00	0.61
3	600096	云天化	2,419,057.00	0.60
4	002497	雅化集团	2,359,372.00	0.58
5	002240	盛新锂能	2,300,014.00	0.57
6	688180	君实生物	1,916,787.79	0.47
7	300390	天华超净	1,891,568.00	0.47
8	002407	多氟多	1,844,726.00	0.46
9	300073	当升科技	1,753,800.00	0.43
10	002756	永兴材料	1,738,333.80	0.43
11	601058	赛轮轮胎	1,651,159.00	0.41
12	688122	西部超导	1,640,942.64	0.41
13	601108	财通证券	1,577,385.40	0.39
14	600499	科达制造	1,432,368.00	0.35
15	000783	长江证券	1,425,876.00	0.35
16	601696	中银证券	1,421,199.00	0.35
17	688777	中控技术	1,409,854.64	0.35
18	601162	天风证券	1,384,799.00	0.34
19	002625	光启技术	1,309,295.00	0.32
20	601607	上海医药	1,279,693.00	0.32

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000733	振华科技	2,909,360.00	0.72
2	002340	格林美	2,490,275.02	0.62
3	600188	兖矿能源	2,461,698.00	0.61
4	300751	迈为股份	2,063,593.60	0.51
5	601117	中国化学	2,035,883.00	0.50
6	000723	美锦能源	1,986,917.00	0.49
7	688005	容百科技	1,817,701.50	0.45
8	600884	杉杉股份	1,663,699.44	0.41
9	601689	拓普集团	1,639,130.56	0.41
10	605358	立昂微	1,618,103.56	0.40

11	300763	锦浪科技	1,580,961.00	0.39
12	600754	锦江酒店	1,530,044.77	0.38
13	688536	思瑞浦	1,162,086.12	0.29
14	300223	北京君正	1,132,850.68	0.28
15	603290	斯达半导	1,122,372.00	0.28
16	600733	北汽蓝谷	1,101,028.00	0.27
17	600803	新奥股份	1,013,288.00	0.25
18	002080	中材科技	998,875.00	0.25
19	601975	招商南油	878,205.00	0.22
20	603893	瑞芯微	861,928.00	0.21

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	143,206,148.27
卖出股票收入（成交）总额	74,630,828.69

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	1,516,834.93	0.35
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）	137,114.97	0.03
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	-	-
10	其他	-	-
11	合计	1,653,949.90	0.38

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	019666	22 国债	15,000	1,516,834.93	0.35

		01			
2	127061	美锦转债	917	108,909.65	0.03
3	127064	杭氧转债	282	28,205.32	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

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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

7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,270,727.63
2	应收清算款	-
3	应收股利	74,113.30

4	应收利息	-
5	应收申购款	2,948,185.32
6	其他应收款	11,040.52
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,304,066.77

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601615	明阳智能	973,440.00	0.23	转融通出借流通受限
2	600256	广汇能源	876,928.00	0.20	转融通出借流通受限
3	600096	云天化	667,376.00	0.16	转融通出借流通受限
4	300012	华测检测	139,260.00	0.03	转融通出借流通受限

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688295	中复神鹰	190,996.58	0.04	新股流通受限
2	688209	英集芯	188,150.76	0.04	新股流通受限

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
汇添富中证 500 指数 (LOF) A	18,565	13,040.23	10,010,000.00	4.13	232,081,866.05	95.87
汇添富中证 500 指数 (LOF) C	22,432	5,477.90	5,904,011.35	4.80	116,976,228.27	95.20
合计	40,997	8,902.41	15,914,011.35	4.36	349,058,094.32	95.64

8.2 期末上市基金前十名持有人

汇添富中证 500 指数 (LOF) A			
序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	张婷	1,152,934.00	11.24
2	周莉萍	454,266.00	4.43
3	邱贤奕	272,300.00	2.65
4	王增有	254,395.00	2.48
5	高倩	198,824.00	1.94
6	钟爱民	166,061.00	1.62
7	高明英	137,684.00	1.34
8	余建萍	127,722.00	1.25
9	韩立钰	119,314.00	1.16
10	刘容	112,300.00	1.09
汇添富中证 500 指数 (LOF) C			
序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	马中鸣	280,000.00	7.83
2	钱中明	265,038.00	7.41
3	虞永金	200,117.00	5.59
4	赵丽妹	200,018.00	5.59
5	于文华	150,175.00	4.20
6	欧阳东	150,000.00	4.19
7	任小疆	128,716.00	3.60
8	王建伟	107,872.00	3.02
9	金林忠	100,000.00	2.80
10	顾奔驰	99,018.00	2.77

注：本基金为 LOF 基金，上表持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	420,475.00	0.17
	汇添富中证 500 指数 (LOF) C	901.37	0.00
	合计	421,376.37	0.12

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C
基金合同生效日 (2017 年 08 月 10 日) 基金份额总额	346,914,435.24	388,890,254.39
本报告期期初基金份额总额	202,719,670.47	105,119,773.46
本报告期基金总申购份额	89,145,305.93	157,989,360.89
减：本报告期基金总赎回	49,773,110.35	140,228,894.73

回份额		
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	242,091,866.05	122,880,239.62

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期无涉及公募基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

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

			额的比例 (%)		比例 (%)	
招商证券	2	211,128,445.95	100.00	151,646.47	100.00	

注:此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计,不单指股票交易佣金。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
招商证券	1,552,166.58	100.00	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

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

公司托管在同一托管银行的基金可以共用同一交易单元进行交易。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 01 日
2	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2021 年第 4 季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 24 日
3	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2021 年年度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 03 月 31 日
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新招募说明书及基金产品资料概要	上交所, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 01 日
5	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2022 年第一季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 22 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

注：无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

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

12.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

12.3 查阅方式

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

汇添富基金管理股份有限公司

2022 年 08 月 31 日