

中创 400 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 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	5
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
3.3 其他指标	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	11
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52

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	52
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	52
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	52
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	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12 投资组合报告附注	52
§ 8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末上市基金前十名持有人	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
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	54
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
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	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4 基金投资策略的改变	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
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	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
10.8 其他重大事件	62
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	63
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	63
§ 12 备查文件目录	63
12.1 备查文件目录	63
12.2 存放地点	63
12.3 查阅方式	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中创 400 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	嘉实中创 400ETF
场内简称	中创 400ETF
基金主代码	159918
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012 年 3 月 22 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	33,561,264.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2012 年 5 月 11 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。
投资策略	<p>本基金采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性原因）导致无法获得足够数量的股票时，或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时，基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到跟踪标的指数的目的。</p> <p>在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过正常范围的，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。</p> <p>对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，筛选具有比较优势的存托凭证作为投资标的。</p>
业绩比较基准	中创 400 指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 姓名	胡勇钦	郭明

负责人	联系电话	(010)65215588	(010)66105799
	电子邮箱	service@jsfund.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-600-8800	95588
传真		(010)65215588	(010)66105798
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 1806A 单元	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		100020	100140
法定代表人		经雷	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金中期报告备置地点	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	341,516.50
本期利润	5,160,309.26
加权平均基金份额本期利润	0.1521
本期加权平均净值利润率	7.94%
本期基金份额净值增长率	8.33%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	30,669,791.18
期末可供分配基金份额利润	0.9138
期末基金资产净值	64,231,055.18
期末基金份额净值	1.9138
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	91.38%

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

（2）上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低

于所列数字。

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

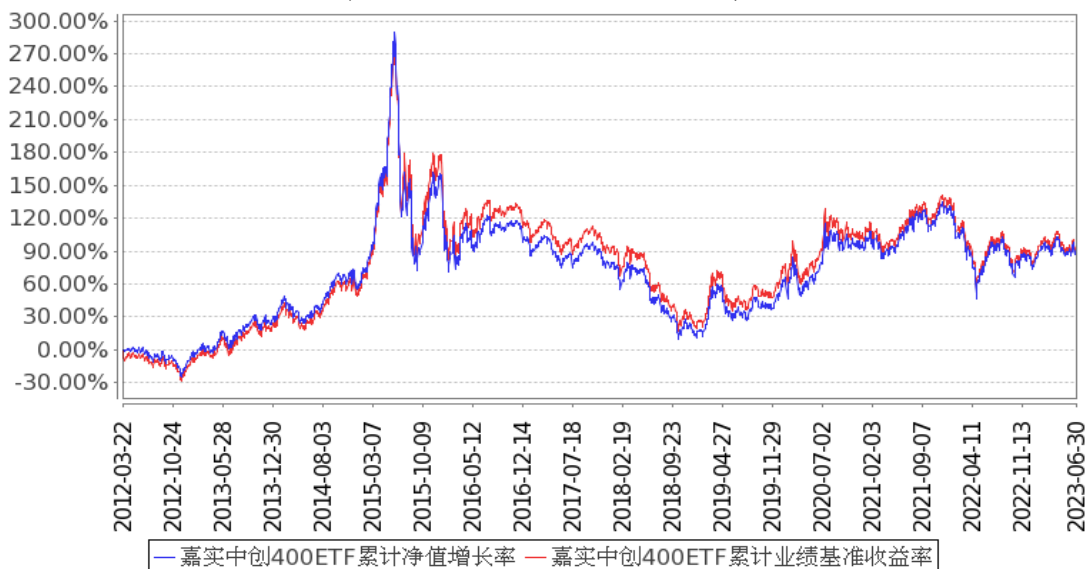
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.22%	1.23%	0.92%	1.25%	0.30%	-0.02%
过去三个月	-2.56%	1.08%	-3.44%	1.10%	0.88%	-0.02%
过去六个月	8.33%	0.99%	7.69%	1.01%	0.64%	-0.02%
过去一年	-2.33%	1.13%	-3.15%	1.15%	0.82%	-0.02%
过去三年	5.13%	1.38%	0.21%	1.39%	4.92%	-0.01%
自基金合同生效起至今	91.38%	1.67%	94.62%	1.70%	-3.24%	-0.03%

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

嘉实中创400ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2012年03月22日至2023年06月30日)



注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起3个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5号文批准，于1999年3月25日成立，是中国第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，总部设在北京并设北京、深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII和特定资产管理业务等资格。

截止2023年6月30日，基金管理人共管理314只公募基金，覆盖主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、资产配置、海外投资、FOF、基础设施基金等不同类别。同时，还管理多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和单一/集合资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
田光远	本基金、嘉实中创400ETF联接、嘉实中证沪港深互联网ETF、嘉实中证软件服务ETF、嘉实中证稀土产业ETF、嘉实中证电池主题ETF、嘉实中证稀土产业ETF联接、嘉实中证新能源ETF、嘉实中证稀有金属主题ETF、嘉实中证软件服务ETF	2021年9月4日	-	8年	曾任华创证券有限责任公司资产管理部量化研究员，2017年4月加入嘉实基金管理有限公司指数投资部，从事指数基金投资研究工作。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

	联接、嘉实中证海外中国互联网 30ETF (QDII)、嘉实中证稀有金属主题 ETF 发起联接、嘉实中证芯片产业指数发起式、嘉实中证电池主题 ETF 发起联接、嘉实上证科创板芯片 ETF、嘉实上证科创板芯片 ETF 发起联接、嘉实北证 50 成份指数基金经理				
--	---	--	--	--	--

注：（1）首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，此后的非首任基金经理的“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期。

（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《中创 400 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的，合计 6 次，均为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪中小创业企业 400 指数，由中创 500 指数剔除同期中创 100 指数成份股后余下的 400 只股票组成，反映中小板和创业板中正处于高成长阶段的企业的整体状况。本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。

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

本报告期内，本基金日均跟踪误差为 0.04%，年化跟踪误差为 0.56%。符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过 0.2%的限制。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.9138 元；本报告期基金份额净值增长率为 8.33%，业绩比较基准收益率为 7.69%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金作为一只投资于中创 400 指数的被动投资管理产品，我们继续秉承指数化被动投资策略，积极应对基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，降低本基金的跟踪误差，给投资

者提供一个标准化的中创 400 指数的投资工具。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括基金投资市场的各证券交易所以及境内相关机构等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期，本基金未实施利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。具体参见本报告“6.4.11 利润分配情况”。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，本基金的管理人——嘉实基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对嘉实基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中创 400 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,235,597.42	1,103,272.96
结算备付金		-	-
存出保证金		592.72	181.14
交易性金融资产	6.4.7.2	63,135,449.30	58,430,641.30
其中：股票投资		63,135,449.30	58,430,641.30
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		64,371,639.44	59,534,095.40
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		27,025.73	25,979.48
应付托管费		5,405.17	5,195.92
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	108,153.36	214,212.64
负债合计		140,584.26	245,388.04
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	33,561,264.00	33,561,264.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	30,669,791.18	25,727,443.36
净资产合计		64,231,055.18	59,288,707.36
负债和净资产总计		64,371,639.44	59,534,095.40

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.9138 元，基金份额总额 33,561,264.00 份。

6.2 利润表

会计主体：中创 400 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		5,490,583.33	-11,222,054.35
1. 利息收入		1,993.77	1,623.53
其中：存款利息收入	6.4.7.13	1,993.77	1,623.53
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		670,162.84	-167,701.53
其中：股票投资收益	6.4.7.14	165,115.19	-634,348.18
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	4,912.15	9,245.97
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-

贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	500,135.50	457,400.68
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.20	4,818,792.76	-11,056,036.25
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.21	-366.04	59.90
减：二、营业总支出		330,274.07	326,705.07
1. 管理人报酬		161,012.79	158,033.66
2. 托管费		32,202.62	31,606.75
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	137,058.66	137,064.66
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		5,160,309.26	-11,548,759.42
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		5,160,309.26	-11,548,759.42
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		5,160,309.26	-11,548,759.42

6.3 净资产(基金净值)变动表

会计主体：中创 400 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	33,561,264.00	-	25,727,443.36	59,288,707.36

加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产(基金净值)	33,561,264.00	-	25,727,443.36	59,288,707.36
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	4,942,347.82	4,942,347.82
(一)、综合收益总额	-	-	5,160,309.26	5,160,309.26
(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)	-	-	-217,961.44	-217,961.44
其中:1.基金申购款	5,000,000.00	-	4,515,312.69	9,515,312.69
2.基金赎回款	-5,000,000.00	-	-4,733,274.13	-9,733,274.13
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值	-	-	-	-

变动(净值减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	33,561,264.00	-	30,669,791.18	64,231,055.18
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	32,561,264.00	-	42,764,352.59	75,325,616.59
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	32,561,264.00	-	42,764,352.59	75,325,616.59
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	-11,522,531.26	-11,522,531.26
(一)、综合收益总额	-	-	-11,548,759.42	-11,548,759.42
(二)、本期基金份额交易产	-	-	26,228.16	26,228.16

生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)				
其中:1. 基金申购款	6,000,000.00	-	4,679,031.76	10,679,031.76
2. 基金赎回款	-6,000,000.00	-	-4,652,803.60	-10,652,803.60
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	32,561,264.00	-	31,241,821.33	63,803,085.33

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

经雷

基金管理人负责人

梁凯

主管会计工作负责人

李袁

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中创 400 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]13 号《关于核准中创 400 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》核准,由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中创 400 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型交易型开放式,存续期限不定。经向中国证监会备案,《中创 400 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2012 年 3 月 22 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 286,561,264.00 份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中创 400 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
活期存款	1,235,597.42
等于：本金	1,235,495.87
加：应计利息	101.55
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	1,235,597.42

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	62,845,896.40	-	63,135,449.30	289,552.90
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	62,845,896.40	-	63,135,449.30	289,552.90

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

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	6,208.70
其中：交易所市场	6,208.70
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	66,944.66
应付指数使用费	35,000.00
合计	108,153.36

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	33,561,264.00	33,561,264.00
本期申购	5,000,000.00	5,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-5,000,000.00	-5,000,000.00
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	33,561,264.00	33,561,264.00

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	32,643,017.72	-6,915,574.36	25,727,443.36
本期利润	341,516.50	4,818,792.76	5,160,309.26
本期基金份额交易产生的变动数	7,787.07	-225,748.51	-217,961.44
其中：基金申购款	4,888,942.77	-373,630.08	4,515,312.69

基金赎回款	-4,881,155.70	147,881.57	-4,733,274.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	32,992,321.29	-2,322,530.11	30,669,791.18

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年1月1日至2023年6月30日	
活期存款利息收入		1,909.35
定期存款利息收入		-
其他存款利息收入		-
结算备付金利息收入		81.74
其他		2.68
合计		1,993.77

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年1月1日至2023年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		-54,089.70
股票投资收益——赎回差价收入		219,204.89
股票投资收益——申购差价收入		-
股票投资收益——证券出借差价收入		-
合计		165,115.19

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年1月1日至2023年6月30日	
卖出股票成交总额		5,751,792.80
减：卖出股票成本总额		5,791,842.45
减：交易费用		14,040.05
买卖股票差价收入		-54,089.70

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年1月1日至2023年6月30日	
赎回基金份额对价总额		9,733,274.13
减：现金支付赎回款总额		27,542.13
减：赎回股票成本总额		9,486,527.11
减：交易费用		-
赎回差价收入		219,204.89

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	1.51
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	4,910.64
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	4,912.15

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	19,912.95
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	15,000.00
减：应计利息总额	1.51
减：交易费用	0.80
买卖债券差价收入	4,910.64

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	500,135.50
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	500,135.50

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	4,818,792.76
股票投资	4,818,792.76
债券投资	-
资产支持证券投资	-

基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
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	4,818,792.76

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	-366.04
合计	-366.04

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	27,273.08
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行划款手续费	114.00
指数使用费	70,000.00
合计	137,058.66

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
-------	---------

嘉实基金管理有限公司(“嘉实基金”)	基金管理人
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人
嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(“嘉实中创 400ETF 联接”)	本基金的联接基金

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	161,012.79	158,033.66
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：1. 支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.50%/当年天数。2. 根据本基金的基金管理人与各代销机构签订的基金代销协议，客户维护费按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
----	--	---

当期发生的基金应支付的托管费	32,202.62	31,606.75
----------------	-----------	-----------

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
嘉实中创 400ETF联接	29,814,808.00	88.84	30,584,808.00	91.13

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司_活期	1,235,597.42	1,909.35	1,048,138.79	1,466.79

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本期(2023年1月1日至2023年6月30日),本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末(2023年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别: 股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001282	三联锻造	2023年5月15日	6个月	新股锁定	27.93	33.03	22	614.46	726.66	-
001286	陕西能源	2023年3月31日	6个月	新股锁定	9.60	9.41	2,731	26,217.60	25,698.71	-
001287	中电港	2023年3月30日	6个月	新股锁定	11.88	21.02	94	1,116.72	1,975.88	-
001324	长青科技	2023年5月12日	6个月	新股锁定	18.88	19.60	32	604.16	627.20	-
001328	登康口腔	2023年3月29日	6个月	新股锁定	20.68	25.49	30	620.40	764.70	-
001360	南矿集团	2023年3月31日	6个月	新股锁定	15.38	14.87	38	584.44	565.06	-
001367	海森药业	2023年3月30日	6个月	新股锁定	44.48	39.48	14	622.72	552.72	-
001380	华纬科技	2023年5月9日	6个月	新股锁定	28.84	30.78	36	1,038.24	1,108.08	-
300804	广康生化	2023年6月15日	6个月	新股锁定	42.45	32.97	50	2,122.50	1,648.50	-
301170	锡南科技	2023年6月16日	6个月	新股锁定	34.00	34.93	47	1,598.00	1,641.71	-
301202	朗威股	2023年	1个月	新发未	25.82	25.82	478	12,341.96	12,341.96	-

	份	6月28日	内(含)	上市							
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股锁定	25.82	25.82	54	1,394.28	1,394.28		-
301225	恒勃股份	2023年6月8日	6个月	新股锁定	35.66	33.26	71	2,531.86	2,361.46		-
301261	恒工精密	2023年6月29日	1个月内(含)	新发未上市	36.90	36.90	329	12,140.10	12,140.10		-
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股锁定	36.90	36.90	37	1,365.30	1,365.30		-
301262	海看股份	2023年6月13日	6个月	新股锁定	30.22	25.50	79	2,387.38	2,014.50		-
301293	三博脑科	2023年4月25日	6个月	新股锁定	29.60	71.42	60	1,776.00	4,285.20		-
301295	美硕科技	2023年6月19日	6个月	新股锁定	37.40	36.07	60	2,244.00	2,164.20		-
301315	威士顿	2023年6月13日	6个月	新股锁定	32.29	51.12	50	1,614.50	2,556.00		-
301320	豪江智能	2023年6月1日	6个月	新股锁定	13.06	20.62	180	2,350.80	3,711.60		-
301323	新莱福	2023年5月29日	6个月	新股锁定	39.06	39.36	37	1,445.22	1,456.32		-
301332	德尔玛	2023年5月9日	6个月	新股锁定	14.81	13.73	144	2,132.64	1,977.12		-
301337	亚华电子	2023年5月16日	6个月	新股锁定	32.60	30.37	53	1,727.80	1,609.61		-
301355	南王科技	2023年6月2日	6个月	新股锁定	17.55	16.75	111	1,948.05	1,859.25		-
301360	荣旗科技	2023年4月17日	6个月	新股锁定	71.88	92.60	27	1,940.76	2,500.20		-
301376	致欧科技	2023年6月14日	6个月	新股锁定	24.66	22.51	77	1,898.82	1,733.27		-
301382	蜂助手	2023年	6个月	新股锁	23.80	32.84	66	1,570.80	2,167.44		-

		5月9日		定							
301383	天键股份	2023年5月31日	6个月	新股锁定	46.16	35.72	70	3,231.20	2,500.40		-
301395	仁信新材	2023年6月21日	1个月内(含)	新发未上市	26.68	26.68	779	20,783.72	20,783.72		-
301395	仁信新材	2023年6月21日	6个月	新股锁定	26.68	26.68	87	2,321.16	2,321.16		-
301428	世纪恒通	2023年5月10日	6个月	新股锁定	26.35	30.60	60	1,581.00	1,836.00		-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，新增股票的受限期、流通受限类型和期末估值价格与原股票一致。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300346	南大光电	2023年6月26日	重大事项停牌	34.39	2023年07月06日	35.60	7,110	224,289.25	244,512.90	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及基金投

资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。本基金的基金管理人按照法律法规和中国证监会的规定，建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构，建立健全内部控制机制和风险管理制度，坚持审慎经营理念，保护投资者利益和公司合法权益。

公司建立包括董事会、管理层、各部门及一线员工组成的四道风控防线，还有董事会风险控制与内审委员会、公司风险控制委员会、督察长及其合规管理部门、风险管理部门，评估各项风险并提出防控措施并有效执行。

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

6.4.13.2 信用风险

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

基金的银行存款存放在托管人和其他拥有相关资质的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均与授权的证券结算机构完成证券交收和款项清算或通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%。本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允

价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,235,597.42	-	-	-	1,235,597.42
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	592.72	-	-	-	592.72
交易性金融资产	-	-	-	63,135,449.30	63,135,449.30
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,236,190.14	-	-	63,135,449.30	64,371,639.44
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	27,025.73	27,025.73
应付托管费	-	-	-	5,405.17	5,405.17

应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	108,153.36	108,153.36
负债总计	-	-	-	140,584.26	140,584.26
利率敏感度缺口	1,236,190.14	-	-	62,994,865.04	64,231,055.18
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,103,272.96	-	-	-	1,103,272.96
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	181.14	-	-	-	181.14
交易性金融资产	-	-	-	58,430,641.30	58,430,641.30
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,103,454.10	-	-	58,430,641.30	59,534,095.40
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	25,979.48	25,979.48
应付托管费	-	-	-	5,195.92	5,195.92
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	214,212.64	214,212.64
负债总计	-	-	-	245,388.04	245,388.04
利率敏感度缺口	1,103,454.10	-	-	58,185,253.26	59,288,707.36

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
分析	市场利率上升 25 个基点	-	-
	市场利率下降 25 个基点	-	-

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
分析	所有外币相对人民币升值 5%	-	-
	所有外币相对人民币贬值 5%	-	-

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	63,135,449.30	98.29	58,430,641.30	98.55
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	63,135,449.30	98.29	58,430,641.30	98.55

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩基准以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
分析	业绩比较基准上升 5%	3,140,519.75	2,932,503.40
	业绩比较基准下降 5%	-3,140,519.75	-2,932,503.40

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	62,770,548.09	58,191,935.30
第二层次	294,859.42	238,706.00
第三层次	70,041.79	-
合计	63,135,449.30	58,430,641.30

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债（上年度末：无）。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
----	----	----	---------------

1	权益投资	63,135,449.30	98.08
	其中：股票	63,135,449.30	98.08
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,235,597.42	1.92
8	其他各项资产	592.72	0.00
9	合计	64,371,639.44	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

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	664,456.70	1.03
B	采矿业	771,032.00	1.20
C	制造业	43,798,794.17	68.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	300,905.20	0.47
E	建筑业	467,259.60	0.73
F	批发和零售业	788,036.80	1.23
G	交通运输、仓储和邮政业	222,583.58	0.35
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,922,012.52	15.45
J	金融业	2,265,451.08	3.53
K	房地产业	241,988.00	0.38
L	租赁和商务服务业	704,455.00	1.10
M	科学研究和技术服务业	1,002,193.00	1.56
N	水利、环境和公共设施管理业	294,261.00	0.46
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	264,610.00	0.41

Q	卫生和社会工作	553,241.00	0.86
R	文化、体育和娱乐业	753,781.34	1.17
S	综合	-	-
	合计	63,015,060.99	98.11

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	76,511.70	0.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	25,698.71	0.04
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	3,709.15	0.01
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	10,183.55	0.02
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,285.20	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	120,388.31	0.19

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	9,400	1,386,030.00	2.16

2	300502	新易盛	9,537	648,229.89	1.01
3	300418	昆仑万维	11,700	471,276.00	0.73
4	002422	科伦药业	15,800	468,944.00	0.73
5	002517	恺英网络	27,800	437,572.00	0.68
6	002463	沪电股份	20,560	430,526.40	0.67
7	300012	华测检测	21,700	423,150.00	0.66
8	002028	思源电气	8,660	404,595.20	0.63
9	002648	卫星化学	26,922	402,753.12	0.63
10	300002	神州泰岳	28,600	400,400.00	0.62
11	002405	四维图新	34,000	393,720.00	0.61
12	300037	新宙邦	7,480	388,137.20	0.60
13	002185	华天科技	40,400	371,680.00	0.58
14	002156	通富微电	16,444	371,634.40	0.58
15	002472	双环传动	10,200	370,260.00	0.58
16	002558	巨人网络	20,100	360,393.00	0.56
17	002436	兴森科技	23,228	360,034.00	0.56
18	300058	蓝色光标	37,100	358,757.00	0.56
19	300394	天孚通信	3,260	348,265.80	0.54
20	002797	第一创业	59,100	338,052.00	0.53
21	002008	大族激光	12,800	335,360.00	0.52
22	300285	国瓷材料	12,100	331,540.00	0.52
23	002223	鱼跃医疗	9,200	331,108.00	0.52
24	002624	完美世界	19,600	331,044.00	0.52
25	002625	光启技术	21,410	326,716.60	0.51
26	002385	大北农	49,500	326,700.00	0.51
27	002044	美年健康	45,300	322,083.00	0.50
28	002409	雅克科技	4,400	320,672.00	0.50
29	300395	菲利华	6,500	319,800.00	0.50
30	300474	景嘉微	3,550	319,464.50	0.50
31	002439	启明星辰	10,700	318,432.00	0.50
32	002966	苏州银行	48,560	318,068.00	0.50
33	300568	星源材质	17,937	308,337.03	0.48
34	002261	拓维信息	15,900	307,029.00	0.48
35	300315	掌趣科技	39,100	304,980.00	0.47
36	300024	机器人	18,100	301,727.00	0.47
37	300253	卫宁健康	27,300	295,386.00	0.46
38	002407	多氟多	14,780	293,530.80	0.46
39	300567	精测电子	3,000	285,450.00	0.44
40	300339	润和软件	11,800	282,728.00	0.44
41	002176	江特电机	23,700	282,504.00	0.44
42	002497	雅化集团	15,878	282,310.84	0.44
43	300459	汤姆猫	43,423	281,815.27	0.44
44	002465	海格通信	26,700	276,078.00	0.43

45	002025	航天电器	4,304	274,595.20	0.43
46	300054	鼎龙股份	10,729	265,328.17	0.41
47	002607	中公教育	56,300	264,610.00	0.41
48	002850	科达利	2,000	264,500.00	0.41
49	300118	东方日升	10,148	260,093.24	0.40
50	002078	太阳纸业	24,204	258,740.76	0.40
51	002368	太极股份	6,251	257,353.67	0.40
52	300604	长川科技	5,400	256,446.00	0.40
53	002262	恩华药业	8,253	254,439.99	0.40
54	300136	信维通信	12,500	251,000.00	0.39
55	002138	顺络电子	10,394	248,520.54	0.39
56	300699	光威复材	8,040	248,034.00	0.39
57	002430	杭氧股份	7,200	247,392.00	0.39
58	300777	中简科技	5,200	245,752.00	0.38
59	002268	电科网安	8,791	245,005.17	0.38
60	300346	南大光电	7,110	244,512.90	0.38
61	002673	西部证券	38,300	243,205.00	0.38
62	002444	巨星科技	11,100	242,868.00	0.38
63	002865	钧达股份	1,578	240,692.34	0.37
64	300438	鹏辉能源	5,000	240,200.00	0.37
65	300487	蓝晓科技	3,825	238,756.50	0.37
66	002195	二三四五	82,200	237,558.00	0.37
67	300573	兴齐眼药	1,100	235,180.00	0.37
68	002152	广电运通	20,000	234,400.00	0.36
69	002281	光迅科技	6,312	234,112.08	0.36
70	002294	信立泰	7,500	233,925.00	0.36
71	002747	埃斯顿	8,300	232,400.00	0.36
72	002065	东华软件	32,700	230,862.00	0.36
73	300383	光环新网	21,200	227,900.00	0.35
74	002056	横店东磁	12,500	227,625.00	0.35
75	002739	万达电影	18,000	225,720.00	0.35
76	300017	网宿科技	31,500	223,965.00	0.35
77	002273	水晶光电	18,680	223,039.20	0.35
78	002595	豪迈科技	6,340	222,724.20	0.35
79	300676	华大基因	3,700	221,963.00	0.35
80	300114	中航电测	4,500	221,175.00	0.34
81	002373	千方科技	16,200	220,968.00	0.34
82	300229	拓尔思	8,500	220,745.00	0.34
83	002456	欧菲光	39,100	218,960.00	0.34
84	300476	胜宏科技	9,080	218,918.80	0.34
85	002531	天顺风能	14,200	216,266.00	0.34
86	002507	涪陵榨菜	11,810	216,241.10	0.34
87	002192	融捷股份	3,200	213,856.00	0.33

88	300001	特锐德	10,274	213,493.72	0.33
89	300212	易华录	6,417	213,236.91	0.33
90	300182	捷成股份	33,714	212,735.34	0.33
91	300633	开立医疗	3,900	212,550.00	0.33
92	300068	南都电源	10,975	212,476.00	0.33
93	002139	拓邦股份	16,100	210,105.00	0.33
94	300866	安克创新	2,400	210,000.00	0.33
95	002402	和而泰	12,300	208,854.00	0.33
96	002203	海亮股份	17,300	207,773.00	0.32
97	002683	广东宏大	7,000	206,080.00	0.32
98	002131	利欧股份	89,454	205,744.20	0.32
99	002851	麦格米特	5,600	204,232.00	0.32
100	300666	江丰电子	3,000	203,880.00	0.32
101	002557	洽洽食品	4,900	203,595.00	0.32
102	300296	利亚德	31,100	203,083.00	0.32
103	002126	银轮股份	11,434	202,381.80	0.32
104	002389	航天彩虹	8,982	199,490.22	0.31
105	300682	朗新科技	8,450	196,716.00	0.31
106	002506	协鑫集成	66,800	195,724.00	0.30
107	002372	伟星新材	9,448	194,061.92	0.30
108	002092	中泰化学	29,900	192,855.00	0.30
109	300558	贝达药业	4,000	192,120.00	0.30
110	300458	全志科技	7,030	191,567.50	0.30
111	002532	天山铝业	31,900	191,081.00	0.30
112	300373	扬杰科技	4,700	190,679.00	0.30
113	300088	长信科技	31,600	190,548.00	0.30
114	300244	迪安诊断	7,400	189,662.00	0.30
115	300803	指南针	3,900	189,501.00	0.30
116	002926	华西证券	22,600	187,806.00	0.29
117	300456	赛微电子	7,650	187,272.00	0.29
118	002151	北斗星通	5,277	185,539.32	0.29
119	002508	老板电器	7,300	184,617.00	0.29
120	002174	游族网络	10,788	181,238.40	0.28
121	002832	比音勒芬	5,062	179,245.42	0.28
122	300034	钢研高纳	4,500	177,255.00	0.28
123	300748	金力永磁	5,900	176,528.00	0.27
124	300251	光线传媒	21,800	176,362.00	0.27
125	002299	圣农发展	9,200	176,180.00	0.27
126	002153	石基信息	12,460	174,440.00	0.27
127	002617	露笑科技	22,100	174,148.00	0.27
128	300393	中来股份	12,300	172,692.00	0.27
129	002015	协鑫能科	12,700	170,561.00	0.27
130	002610	爱康科技	66,600	170,496.00	0.27

131	002484	江海股份	8,000	170,320.00	0.27
132	002254	泰和新材	6,940	169,821.80	0.26
133	002335	科华数据	4,700	168,965.00	0.26
134	002500	山西证券	30,280	168,962.40	0.26
135	002936	郑州银行	73,042	167,996.60	0.26
136	002019	亿帆医药	11,500	167,900.00	0.26
137	002541	鸿路钢构	5,810	167,386.10	0.26
138	002318	久立特材	9,800	166,894.00	0.26
139	002698	博实股份	9,500	166,155.00	0.26
140	300294	博雅生物	4,550	165,074.00	0.26
141	300009	安科生物	16,488	164,880.00	0.26
142	002245	蔚蓝锂芯	14,900	163,155.00	0.25
143	002317	众生药业	9,500	161,405.00	0.25
144	002128	电投能源	12,200	161,284.00	0.25
145	300036	超图软件	6,800	161,228.00	0.25
146	002429	兆驰股份	29,300	161,150.00	0.25
147	002145	中核钛白	27,195	160,178.55	0.25
148	002958	青农商行	58,800	159,936.00	0.25
149	002212	天融信	16,300	158,110.00	0.25
150	002396	星网锐捷	6,993	157,971.87	0.25
151	301236	软通动力	5,800	157,818.00	0.25
152	300026	红日药业	29,100	157,722.00	0.25
153	300529	健帆生物	6,800	157,624.00	0.25
154	002063	远光软件	18,042	156,604.56	0.24
155	300168	万达信息	13,800	156,354.00	0.24
156	002182	云海金属	7,100	156,129.00	0.24
157	300593	新雷能	6,788	155,513.08	0.24
158	300775	三角防务	4,600	155,388.00	0.24
159	300451	创业慧康	18,435	154,485.30	0.24
160	002487	大金重工	5,000	154,200.00	0.24
161	002030	达安基因	15,420	153,737.40	0.24
162	002837	英维克	5,100	152,694.00	0.24
163	300638	广和通	6,726	152,545.68	0.24
164	002332	仙琚制药	11,500	152,375.00	0.24
165	300188	美亚柏科	7,320	152,182.80	0.24
166	002155	湖南黄金	12,400	151,280.00	0.24
167	300363	博腾股份	5,100	150,909.00	0.23
168	002643	万润股份	8,650	150,596.50	0.23
169	300166	东方国信	13,356	150,121.44	0.23
170	002244	滨江集团	17,000	149,940.00	0.23
171	300747	锐科激光	4,912	149,717.76	0.23
172	300677	英科医疗	6,800	149,600.00	0.23
173	002036	联创电子	15,376	149,300.96	0.23

174	002326	永太科技	9,764	149,291.56	0.23
175	300070	碧水源	27,700	148,472.00	0.23
176	002518	科士达	3,700	148,037.00	0.23
177	002408	齐翔腾达	23,099	147,140.63	0.23
178	300674	宇信科技	8,320	147,097.60	0.23
179	002266	浙富控股	35,300	145,789.00	0.23
180	300655	晶瑞电材	7,282	144,984.62	0.23
181	002706	良信股份	12,880	144,900.00	0.23
182	002831	裕同科技	5,940	144,876.60	0.23
183	300357	我武生物	4,300	144,609.00	0.23
184	300115	长盈精密	12,066	143,706.06	0.22
185	300776	帝尔激光	2,208	143,299.20	0.22
186	300773	拉卡拉	8,200	143,008.00	0.22
187	002572	索菲亚	8,200	142,844.00	0.22
188	300379	东方通	6,940	142,755.80	0.22
189	300627	华测导航	4,360	141,569.20	0.22
190	002249	大洋电机	24,588	140,151.60	0.22
191	002675	东诚药业	9,500	139,745.00	0.22
192	002183	怡亚通	27,400	139,740.00	0.22
193	002544	普天科技	6,084	139,323.60	0.22
194	300133	华策影视	19,600	138,964.00	0.22
195	002585	双星新材	11,000	138,160.00	0.22
196	002424	贵州百灵	15,100	135,598.00	0.21
197	300679	电连技术	4,100	135,505.00	0.21
198	002123	梦网科技	10,173	135,199.17	0.21
199	002099	海翔药业	15,572	133,763.48	0.21
200	002100	天康生物	16,100	132,825.00	0.21
201	002312	川发龙蟒	16,300	132,519.00	0.21
202	300113	顺网科技	7,700	132,517.00	0.21
203	300298	三诺生物	4,900	132,496.00	0.21
204	002727	一心堂	5,000	132,000.00	0.21
205	300432	富临精工	11,300	131,306.00	0.20
206	002221	东华能源	15,000	129,750.00	0.20
207	002984	森麒麟	4,100	128,986.00	0.20
208	002807	江阴银行	34,882	128,714.58	0.20
209	300185	通裕重工	46,000	128,340.00	0.20
210	300327	中颖电子	4,588	128,280.48	0.20
211	002690	美亚光电	4,960	127,720.00	0.20
212	002351	漫步者	6,100	126,148.00	0.20
213	300525	博思软件	8,220	126,094.80	0.20
214	300888	稳健医疗	3,020	125,843.40	0.20
215	301035	润丰股份	1,600	125,712.00	0.20
216	002085	万丰奥威	18,100	125,433.00	0.20

217	300672	国科微	1,500	125,025.00	0.19
218	002701	奥瑞金	27,700	124,927.00	0.19
219	300236	上海新阳	3,150	124,897.50	0.19
220	300101	振芯科技	6,400	124,096.00	0.19
221	301050	雷电微力	1,900	123,367.00	0.19
222	002011	盾安环境	8,900	123,087.00	0.19
223	002985	北摩高科	2,759	121,727.08	0.19
224	002217	合力泰	34,100	120,373.00	0.19
225	300079	数码视讯	19,700	120,170.00	0.19
226	002387	维信诺	13,100	120,127.00	0.19
227	003031	中瓷电子	900	119,808.00	0.19
228	002597	金禾实业	5,000	118,000.00	0.18
229	300725	药石科技	2,430	117,684.90	0.18
230	002511	中顺洁柔	10,540	117,521.00	0.18
231	002324	普利特	8,200	117,014.00	0.18
232	002745	木林森	12,700	116,840.00	0.18
233	003035	南网能源	16,400	116,768.00	0.18
234	002791	坚朗五金	1,800	116,478.00	0.18
235	002250	联化科技	11,100	116,106.00	0.18
236	301155	海力风电	1,500	115,620.00	0.18
237	002004	华邦健康	23,000	115,000.00	0.18
238	300618	寒锐钴业	3,540	114,731.40	0.18
239	002458	益生股份	9,282	114,632.70	0.18
240	300035	中科电气	9,500	114,190.00	0.18
241	002867	周大生	6,375	113,347.50	0.18
242	300855	图南股份	3,190	112,670.80	0.18
243	002091	江苏国泰	14,645	110,423.30	0.17
244	300369	绿盟科技	8,899	110,080.63	0.17
245	300910	瑞丰新材	2,180	109,654.00	0.17
246	002061	浙江交科	24,240	108,110.40	0.17
247	300482	万孚生物	4,036	107,478.68	0.17
248	300376	易事特	16,000	107,200.00	0.17
249	300087	荃银高科	10,310	106,605.40	0.17
250	002127	南极电商	27,800	106,474.00	0.17
251	300827	上能电气	2,945	106,167.25	0.17
252	002839	张家港行	25,080	106,088.40	0.17
253	002124	天邦食品	23,340	105,963.60	0.16
254	300260	新莱应材	2,680	105,913.60	0.16
255	002468	申通快递	9,700	104,954.00	0.16
256	002075	沙钢股份	26,100	104,661.00	0.16
257	002567	唐人神	15,700	104,405.00	0.16
258	300685	艾德生物	4,290	104,075.40	0.16
259	002038	双鹭药业	10,300	103,927.00	0.16

260	002960	青鸟消防	5,690	103,614.90	0.16
261	300861	美畅股份	2,380	103,220.60	0.16
262	300463	迈克生物	6,800	102,816.00	0.16
263	300850	新强联	2,750	102,795.00	0.16
264	300398	飞凯材料	5,960	102,452.40	0.16
265	300623	捷捷微电	5,650	102,378.00	0.16
266	002737	葵花药业	4,200	102,228.00	0.16
267	301071	力量钻石	2,320	102,080.00	0.16
268	002010	传化智联	18,700	99,484.00	0.15
269	300348	长亮科技	9,525	99,441.00	0.15
270	002773	康弘药业	5,200	99,424.00	0.15
271	301039	中集车辆	7,500	99,225.00	0.15
272	002258	利尔化学	7,640	98,632.40	0.15
273	300671	富满微	2,400	98,064.00	0.15
274	300762	上海瀚讯	8,312	97,832.24	0.15
275	002048	宁波华翔	7,300	97,820.00	0.15
276	002505	鹏都农牧	51,750	97,807.50	0.15
276	002847	盐津铺子	1,150	97,807.50	0.15
277	002081	金螳螂	21,500	96,965.00	0.15
278	002214	大立科技	7,100	96,915.00	0.15
279	300613	富瀚微	1,705	96,741.70	0.15
280	301268	铭利达	2,300	96,301.00	0.15
281	300457	赢合科技	5,450	96,247.00	0.15
282	300199	翰宇药业	9,400	95,692.00	0.15
283	002163	海南发展	9,500	95,000.00	0.15
284	002237	恒邦股份	8,600	93,654.00	0.15
285	300406	九强生物	4,000	93,320.00	0.15
286	300171	东富龙	4,100	93,275.00	0.15
287	002171	楚江新材	13,100	93,272.00	0.15
288	300257	开山股份	6,100	92,537.00	0.14
289	300443	金雷股份	2,600	92,170.00	0.14
290	002239	奥特佳	34,500	92,115.00	0.14
291	002423	中粮资本	11,500	92,000.00	0.14
292	002002	鸿达兴业	41,015	91,873.60	0.14
293	300770	新媒股份	2,000	91,720.00	0.14
294	300737	科顺股份	9,940	91,050.40	0.14
295	002191	劲嘉股份	14,900	89,698.00	0.14
296	300726	宏达电子	2,000	89,440.00	0.14
297	300224	正海磁材	6,953	89,415.58	0.14
298	002948	青岛银行	28,420	88,954.60	0.14
299	002233	塔牌集团	11,500	88,780.00	0.14
300	002705	新宝股份	4,900	88,347.00	0.14
301	002051	中工国际	7,340	87,566.20	0.14

302	300233	金城医药	4,600	87,446.00	0.14
303	002382	蓝帆医疗	12,100	86,878.00	0.14
304	002726	龙大美食	10,460	86,713.40	0.14
305	002626	金达威	4,600	86,434.00	0.13
306	301047	义翘神州	1,000	85,700.00	0.13
307	002041	登海种业	5,600	85,512.00	0.13
308	300409	道氏技术	6,800	85,476.00	0.13
309	002906	华阳集团	2,500	85,475.00	0.13
310	002583	海能达	14,690	85,348.90	0.13
311	002859	洁美科技	3,080	85,316.00	0.13
312	300772	运达股份	6,620	85,265.60	0.13
313	002158	汉钟精机	3,400	84,864.00	0.13
314	002101	广东鸿图	4,300	84,194.00	0.13
315	300072	海新能科	24,300	83,106.00	0.13
316	300630	普利制药	4,231	82,716.05	0.13
317	002967	广电计量	4,100	82,369.00	0.13
318	300973	立高食品	1,200	82,104.00	0.13
319	002925	盈趣科技	4,230	82,062.00	0.13
320	002539	云图控股	9,100	81,718.00	0.13
321	300323	华灿光电	11,900	81,515.00	0.13
322	300151	昌红科技	4,500	81,450.00	0.13
323	002390	信邦制药	18,000	79,740.00	0.12
324	002434	万里扬	8,900	79,655.00	0.12
325	002060	粤水电	12,100	79,618.00	0.12
326	300841	康华生物	1,200	79,068.00	0.12
327	002216	三全食品	4,960	77,276.80	0.12
328	002670	国盛金控	8,675	76,166.50	0.12
329	002453	华软科技	7,100	75,899.00	0.12
330	300761	立华股份	4,100	75,563.00	0.12
331	002416	爱施德	10,100	74,538.00	0.12
332	002608	江苏国信	9,700	73,429.00	0.11
333	301078	孩子王	6,400	73,152.00	0.11
334	002498	汉缆股份	18,100	72,581.00	0.11
335	301080	百普赛斯	1,150	72,243.00	0.11
336	300428	立中集团	3,100	71,486.00	0.11
337	002243	力合科创	8,400	71,484.00	0.11
338	002612	朗姿股份	3,000	71,340.00	0.11
339	301029	怡合达	1,588	70,951.84	0.11
340	002110	三钢闽光	16,800	70,896.00	0.11
341	002440	闰土股份	10,538	70,288.46	0.11
342	002563	森马服饰	11,300	70,286.00	0.11
343	300382	斯莱克	5,300	69,907.00	0.11
344	002635	安洁科技	5,050	69,690.00	0.11

345	002895	川恒股份	3,500	68,950.00	0.11
346	002653	海思科	2,900	68,440.00	0.11
347	301089	拓新药业	1,100	68,134.00	0.11
348	002959	小熊电器	800	66,800.00	0.10
349	301095	广立微	800	66,120.00	0.10
350	002226	江南化工	12,900	65,403.00	0.10
351	002242	九阳股份	4,100	61,295.00	0.10
352	301219	腾远钴业	1,640	61,270.40	0.10
353	301308	江波龙	600	61,056.00	0.10
354	002815	崇达技术	4,831	60,145.95	0.09
355	002204	大连重工	11,700	60,138.00	0.09
356	300767	震安科技	2,336	59,240.96	0.09
357	002320	海峡股份	9,752	58,902.08	0.09
358	002928	华夏航空	6,950	58,727.50	0.09
359	002545	东方铁塔	8,200	57,892.00	0.09
360	002810	山东赫达	3,200	57,600.00	0.09
361	300869	康泰医学	2,500	57,400.00	0.09
362	002913	奥士康	1,500	57,270.00	0.09
363	002302	西部建设	8,000	57,120.00	0.09
364	002645	华宏科技	4,600	56,396.00	0.09
365	003012	东鹏控股	6,900	55,821.00	0.09
366	300080	易成新能	10,800	54,972.00	0.09
367	002993	奥海科技	1,600	54,272.00	0.08
368	301217	铜冠铜箔	3,800	54,074.00	0.08
369	300702	天宇股份	2,140	51,937.80	0.08
370	300894	火星人	2,000	51,080.00	0.08
371	301238	瑞泰新材	2,500	50,850.00	0.08
372	300783	三只松鼠	2,600	50,804.00	0.08
373	300821	东岳硅材	5,200	50,648.00	0.08
374	300768	迪普科技	3,050	50,538.50	0.08
375	301015	百洋医药	1,800	49,968.00	0.08
376	002088	鲁阳节能	2,700	49,788.00	0.08
377	002461	珠江啤酒	5,600	49,336.00	0.08
378	002399	海普瑞	4,300	49,321.00	0.08
379	003040	楚天龙	2,700	48,978.00	0.08
380	300602	飞荣达	3,161	48,963.89	0.08
381	301069	凯盛新材	1,900	48,336.00	0.08
382	301327	华宝新能	600	47,466.00	0.07
383	002534	西子洁能	2,800	47,040.00	0.07
384	002146	荣盛发展	30,200	46,508.00	0.07
385	002314	南山控股	13,800	45,540.00	0.07
386	301090	华润材料	3,600	45,432.00	0.07
387	300755	华致酒行	1,900	42,693.00	0.07

388	301207	华兰疫苗	1,250	41,575.00	0.06
389	002793	罗欣药业	7,700	41,503.00	0.06
390	301060	兰卫医学	2,400	41,496.00	0.06
391	002978	安宁股份	1,200	38,532.00	0.06
392	300741	华宝股份	1,798	38,513.16	0.06
393	002946	新乳业	2,400	34,440.00	0.05
394	003039	顺控发展	1,900	32,224.00	0.05
395	301200	大族数控	800	31,904.00	0.05
396	002901	大博医疗	1,000	31,080.00	0.05
397	301363	美好医疗	700	30,793.00	0.05
398	301177	迪阿股份	700	26,901.00	0.04
399	002911	佛燃能源	1,920	24,691.20	0.04

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	001286	陕西能源	2,731	25,698.71	0.04
2	301395	仁信新材	866	23,104.88	0.04
3	301202	朗威股份	532	13,736.24	0.02
4	301261	恒工精密	366	13,505.40	0.02
5	301293	三博脑科	60	4,285.20	0.01
6	301320	豪江智能	180	3,711.60	0.01
7	301315	威士顿	50	2,556.00	0.00
8	301383	天键股份	70	2,500.40	0.00
9	301360	荣旗科技	27	2,500.20	0.00
10	301225	恒勃股份	71	2,361.46	0.00
11	301382	蜂助手	66	2,167.44	0.00
12	301295	美硕科技	60	2,164.20	0.00
13	301262	海看股份	79	2,014.50	0.00
14	301332	德尔玛	144	1,977.12	0.00
15	001287	中电港	94	1,975.88	0.00
16	301355	南王科技	111	1,859.25	0.00
17	301428	世纪恒通	60	1,836.00	0.00
18	301376	致欧科技	77	1,733.27	0.00
19	300804	广康生化	50	1,648.50	0.00
20	301170	锡南科技	47	1,641.71	0.00
21	301337	亚华电子	53	1,609.61	0.00
22	301323	新莱福	37	1,456.32	0.00
23	001380	华纬科技	36	1,108.08	0.00
24	001328	登康口腔	30	764.70	0.00
25	001282	三联锻造	22	726.66	0.00
26	001324	长青科技	32	627.20	0.00
27	001360	南矿集团	38	565.06	0.00
28	001367	海森药业	14	552.72	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	002008	大族激光	324,354.00	0.55
2	300229	拓尔思	266,448.00	0.45
3	001286	陕西能源	262,166.40	0.44
4	300114	中航电测	220,806.00	0.37
5	002015	协鑫能科	201,641.00	0.34
6	300529	健帆生物	191,088.00	0.32
7	300393	中来股份	175,331.00	0.30
8	300363	博腾股份	165,835.00	0.28
9	002607	中公教育	144,374.00	0.24
10	301236	软通动力	113,521.00	0.19
11	002060	粤水电	81,921.00	0.14
12	301268	铭利达	79,095.00	0.13
13	002156	通富微电	73,172.00	0.12
14	300459	汤姆猫	72,298.00	0.12
15	301095	广立微	69,895.00	0.12
16	002088	鲁阳节能	65,987.00	0.11
17	301308	江波龙	63,661.00	0.11
18	300666	江丰电子	58,234.00	0.10
19	301238	瑞泰新材	56,281.00	0.09
20	301327	华宝新能	45,711.00	0.08

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	001286	陕西能源	345,980.46	0.58
2	002568	百润股份	315,370.00	0.53
3	300832	新产业	277,258.00	0.47
4	002353	杰瑞股份	235,569.00	0.40
5	002648	卫星化学	157,715.00	0.27
6	002280	联络互动	112,530.00	0.19
7	002023	海特高新	89,528.20	0.15
8	001301	尚太科技	84,583.00	0.14
9	002097	山河智能	72,853.56	0.12
10	300735	光弘科技	69,426.00	0.12
11	002157	*ST 正邦	67,138.00	0.11
12	300639	凯普生物	62,703.85	0.11
13	002481	双塔食品	53,081.00	0.09
14	001311	多利科技	50,415.40	0.09

15	002677	浙江美大	43,644.00	0.07
16	301320	豪江智能	43,031.78	0.07
17	300418	昆仑万维	36,788.00	0.06
18	002950	奥美医疗	35,321.50	0.06
19	300012	华测检测	33,814.00	0.06
20	002405	四维图新	33,602.00	0.06

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	5,673,975.60
卖出股票收入（成交）总额	5,751,792.80

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

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

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在

报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	592.72
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	592.72

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

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	001286	陕西能源	25,698.71	0.04	新股锁定
2	301395	仁信新材	20,783.72	0.03	新发未上市
2	301395	仁信新材	2,321.16	0.00	新股锁定
3	301202	朗威股份	12,341.96	0.02	新发未上市
3	301202	朗威股份	1,394.28	0.00	新股锁定
4	301261	恒工精密	12,140.10	0.02	新发未上市
4	301261	恒工精密	1,365.30	0.00	新股锁定
5	301293	三博脑科	4,285.20	0.01	新股锁定

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
314	106,883.01	31,686,839.00	94.41	1,874,425.00	5.59

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
嘉实中创 400 交易型开放式 指数证券投资基金联接基金	29,814,808.00	88.84

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	海通证券股份有限公司	1,037,800.00	3.09
2	中信证券股份有限公司	834,231.00	2.49
3	徐隽婵	103,270.00	0.31
4	谭惠玲	100,009.00	0.30
5	骆华星	78,355.00	0.23
6	马阿传	70,712.00	0.21
7	刘亦男	63,600.00	0.19
8	刘子瑛	60,000.00	0.18
9	周曦	48,150.00	0.14
10	杨龙溪	36,100.00	0.11
11	嘉实中创 400 交易型开 放式指数证券投资基 金联接基金	29,814,808.00	88.84

注：上述基金持有人份额均为场内基金份额。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012年3月22日） 基金份额总额	286,561,264.00
本报告期期初基金份额总额	33,561,264.00
本报告期基金总申购份额	5,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	5,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	33,561,264.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

2023年4月29日，本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，张峰先生任公司副总经理。

2023年4月29日，本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，程剑先生任公司副总经理。

2023年4月29日，本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，李明先生任公司财务总监。

2023年6月20日，本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，姚志鹏先生任公司副总经理。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所，会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国金证券股份有限公司	1	10,643,390.80	100.00	7,450.63	100.00	-
安信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
财通证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

高盛（中国）证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	5	-	-	-	-	-
国都证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国联证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	4	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
华宝证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华福证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华金证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
开源证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-

股份有限 公司						
申万宏源 证券有限 公司	1	-	-	-	-	-
天风证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
兴业证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
招商证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
浙商证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
中国国际 金融股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
中国银河 证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中金 财富证券 有限公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
中信建投 证券股份 有限公司	3	-	-	-	-	-
中信证券 股份有限 公司	4	-	-	-	-	-
中银国际 证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-

注：1. 本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

2. 交易单元的选择标准和程序

(1) 经营行为规范；

(2) 财务状况良好；

(3) 研究能力较强；

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

3. 高盛高华证券有限责任公司更名为高盛（中国）证券有限责任公司。

4. 报告期内，本基金退租以下交易单元：长江证券股份有限公司退租交易单元 1 个。

5. 报告期内，本基金新增以下交易单元：财通证券股份有限公司新增交易单元 2 个，广发证券股份有限公司新增交易单元 2 个，国联证券股份有限公司新增交易单元 2 个，国盛证券有限责任公司新增交易单元 2 个，华泰证券股份有限公司新增交易单元 2 个。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
国金证券股份有限公司	19,912.95	100.00	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
财通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

司						
东吴证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
东兴证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
高盛(中 国)证 券有 限责 任公 司	-	-	-	-	-	-
光大证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
广发证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国都证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国联证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国盛证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-
国泰君 安证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国信证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
海通证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-

司						
华宝证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
华福证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-
华金证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
华泰证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
开源证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
民生证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证券 有限公 司	-	-	-	-	-	-
天风证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
兴业证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
招商证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
浙商证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-

司						
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国中金财富证券有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	嘉实基金管理有限公司关于防范不法分子诈骗活动的提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年3月21日
2	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年4月29日
3	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年6月20日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
联接基金	1	2023-01-01 至 2023-06-30	30,584,808.00	3,000,000.00	3,770,000.00	29,814,808.00	88.84
产品特有风险							
<p>报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。</p> <p>未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式或者与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准中创 400 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- (2) 《中创 400 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- (3) 《中创 400 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《中创 400 交易型开放式指数证券投资基金基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内中创 400 交易型开放式指数证券投资基金公告的各项原稿。

12.2 存放地点

北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

12.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.jsfund.cn>

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-600-8800，或发 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2023 年 8 月 29 日