

天弘中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:天弘基金管理有限公司

基金托管人:国泰君安证券股份有限公司

送出日期:2024 年 08 月 30 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年08月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年01月01日起至2024年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告.....	76
7.1 期末基金资产组合情况.....	76
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	77
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	79
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	96
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	98
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	99
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	99
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	99
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	99
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	99
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	100
7.12 投资组合报告附注	100
§8 基金份额持有人信息.....	101
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	101
8.2 期末上市基金前十名持有人	102

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	103
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	103
§9 开放式基金份额变动.....	103
§10 重大事件揭示.....	103
10.1 基金份额持有人大会决议.....	103
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.....	103
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	104
10.4 基金投资策略的改变.....	104
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	104
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	104
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	104
10.8 其他重大事件.....	107
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	109
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.....	109
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	110
§12 备查文件目录.....	110
12.1 备查文件目录.....	110
12.2 存放地点.....	110
12.3 查阅方式.....	110

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	天弘中证500ETF
场内简称	中证500ETF天弘
基金主代码	159820
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020年08月07日
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,501,408,470.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2020年08月24日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在0.2%以内，年化跟踪误差控制在2%以内。
投资策略	本基金主要采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况（如流动性不足、成份股长期停牌、法律法规限制等）导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。为使得基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数，基金可投资于经中国证监会允许的各种金融衍生产品，如股指期货以及其他与标的指数或标的指数成份

	股相关的衍生工具。本基金产品投资策略仍包括债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略、存托凭证投资策略等。
业绩比较基准	中证500指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		天弘基金管理有限公司	国泰君安证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林	帅芳
	联系电话	022-83310208	021-38031815
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	tgrxp@tg.gtja.com
客户服务电话		95046	021-38917599-5
传真		022-83865564	021-38677819
注册地址		天津自贸试验区（中心商务区）新华路3678号宝风大厦23层	中国（上海）自由贸易试验区商城路618号
办公地址		天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层	上海市静安区新闻路669号博华广场19楼
邮政编码		300203	200041
法定代表人		韩歆毅	朱健

2.4 信息披露方式

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

址	
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2024年01月01日-2024年06月30日)	
	本期已实现收益	-85,632,039.57
本期利润	-166,143,192.01	
加权平均基金份额本期利润	-0.0666	
本期加权平均净值利润率	-7.75%	
本期基金份额净值增长率	-7.91%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)	
	期末可供分配利润	-454,905,191.66
	期末可供分配基金份额利润	-0.1819
	期末基金资产净值	2,046,503,278.34
	期末基金份额净值	0.8181
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024年06月30日)	
	基金份额累计净值增长率	-18.19%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-6.29%	0.96%	-6.89%	0.96%	0.60%	0.00%
过去三个月	-5.38%	1.14%	-6.50%	1.14%	1.12%	0.00%
过去六个月	-7.91%	1.60%	-8.96%	1.61%	1.05%	-0.01%
过去一年	-16.26%	1.27%	-17.60%	1.27%	1.34%	0.00%
过去三年	-22.73%	1.19%	-27.40%	1.20%	4.67%	-0.01%
自基金合同生效日起至 今	-18.19%	1.16%	-26.99%	1.17%	8.80%	-0.01%

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



- 注：1、本基金合同于2020年08月07日生效。
2、本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

截至2024年6月30日，公司共管理运作197只公募基金，公司业务范围涵盖二级市场股票投资、债券投资、现金管理、衍生品投资等。公司始终秉承“稳健理财，值得信赖”的理念，坚持为投资者带来优质的基金产品和理财服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈瑶	本基金基金经理	2020年08月	-	13年	女，金融学硕士。2011年7月加盟本公司，历任交易员、交易主管，从事交易管理、程序化交易策略、基差交易策略、融资融券交易策略等研究工作。

注：1、上述任职日期/离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、在本报告截止日至报告批准送出日之间，本基金管理人增聘尤聪女士为本基金经理助理。

3、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其配套规则和其他相关法律法规、基金合同的有关规定，勤勉尽责地管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公平交易的执行情况包括：建立统一的研究平台和公共信息平台，保证各组合得到公平的投资资讯；公平对待不同投资组合，禁止各投资组合之间进行以利益输送为目的的投资交易活动；在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，严格执行授权审批程

序；实行集中交易制度和公平交易分配制度；建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度，保证不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息的相互隔离；加强对投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系等。

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

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

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

报告期内，本基金整体运行平稳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2024年06月30日，本基金份额净值为0.8181元，本报告期份额净值增长率-7.91%，同期业绩比较基准增长率-8.96%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前由于地产风险及景气度的滑落，居民端对于收入和就业前景的预期，在投资和消费两端，都尚未观测到明确能够支撑经济强修复的持续动能，宏观基本面修复的持续性仍然有待观察，市场整体情绪也处于较为谨慎收敛的状态，市场缺乏可投资的相对高收益资产。市场对资产欠配问题的关注度在上升。随着近年来利率的持续下行，高收益资产逐渐减少，债券的期限利差和信用利差快速收窄，资金具有一定的欠配压力。我们认为，资产欠配问题的持续可能会倒逼资金的风险偏好在可接受的范围内进行有限扩张，扩散到股票市场，对部分赛道形成资金支撑，若宏观经济存在更加明确的利好催化，那么这一趋势可能更加明显。

基于这一逻辑，我们认为股票市场在2024年下半年从风格上看，更可能的趋势是大小盘并重，先大后小，互相轮动。防御型的红利赛道仍是资金的关注点之一，资产欠配情形下，风险偏好的有限扩张与红利赛道契合。但与此同时，也需要关注在持续上涨后，实际股息率的变化可能带来这一赛道的向外扩散或短期修正。同时，具有相对确定性的主题投资机会，也是在市场风险偏好未明显提升时的一个投资主线。

从中长期看，当前股票市场的底部区域特征还是较为明确的，政策底的信号已经明确，各种政策仍在不断接续，当前的指数点位已经处于较低位置。中长期我们可以对中国经济的修复更加乐观一些。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模

型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签订与估值相关的定价服务协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末	上年度末
----	-----	-----	------

		2024年06月30日	2023年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	14,457,620.90	18,144,345.68
结算备付金		32,741,435.25	64,244,903.92
存出保证金		6,234,690.20	10,640,785.13
交易性金融资产	6.4.7.2	1,994,185,469.25	2,113,302,063.13
其中：股票投资		1,993,813,441.53	2,113,138,158.10
基金投资		-	-
债券投资		372,027.72	163,905.03
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	-	-
应收清算款		3,221,554.72	9,105,378.05
应收股利		220,594.73	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	141,316.65	132,673.59
资产总计		2,051,202,681.70	2,215,570,149.50
负债和净资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		3,181,546.80	9,242,508.41
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		866,198.06	923,303.65

应付托管费		173,239.65	184,660.74
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		15,489.71	12,049.76
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	462,929.14	691,194.50
负债合计		4,699,403.36	11,053,717.06
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	2,501,408,470.00	2,481,408,470.00
未分配利润	6.4.7.8	-454,905,191.66	-276,892,037.56
净资产合计		2,046,503,278.34	2,204,516,432.44
负债和净资产总计		2,051,202,681.70	2,215,570,149.50

注：报告截止日2024年06月30日，基金份额净值0.8181元，基金份额总额2,501,408,470.00份。

6.2 利润表

会计主体：天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至202 3年06月30日
一、营业总收入		-159,184,036.04	100,868,160.70
1.利息收入		163,616.93	173,078.14
其中：存款利息收入	6.4.7.9	163,616.93	173,078.14
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		-	-
其他利息收入		-	-

2.投资收益（损失以“-”填列）		-79,706,123.75	-25,373,607.41
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-106,222,420.94	-56,028,624.86
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	40,429.95	318,621.52
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-3,378,373.96	1,692,360.73
股利收益	6.4.7.15	27,619,929.16	25,903,780.34
其他投资收益		2,234,312.04	2,740,254.86
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-80,511,152.44	125,924,913.03
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	869,623.22	143,776.94
减：二、营业总支出		6,959,155.97	7,649,868.59
1.管理人报酬		5,345,889.02	5,882,388.91
2.托管费		1,069,177.82	1,176,477.78
3.销售服务费		-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6.信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7.税金及附加		8,854.44	24,129.86
8.其他费用	6.4.7.19	535,234.69	566,872.04
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-166,143,192.01	93,218,292.11
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-166,143,192.01	93,218,292.11
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-166,143,192.01	93,218,292.11

6.3 净资产变动表

会计主体：天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024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	2,481,408,470.00	-276,892,037.56	2,204,516,432.44
二、本期期初净资产	2,481,408,470.00	-276,892,037.56	2,204,516,432.44
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	20,000,000.00	-178,013,154.10	-158,013,154.10
（一）、综合收益总额	-	-166,143,192.01	-166,143,192.01
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	20,000,000.00	-11,869,962.09	8,130,037.91
其中：1.基金申购款	252,500,000.00	-42,728,461.13	209,771,538.87
2.基金赎回款	-232,500,000.00	30,858,499.04	-201,641,500.96
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产	-	-	-

变动（净资产减少以“-”号填列）			
四、本期期末净资产	2,501,408,470.00	-454,905,191.66	2,046,503,278.34
项目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,476,408,470.00	-142,437,349.55	2,333,971,120.45
二、本期期初净资产	2,476,408,470.00	-142,437,349.55	2,333,971,120.45
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-145,000,000.00	88,846,743.39	-56,153,256.61
（一）、综合收益总额	-	93,218,292.11	93,218,292.11
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-145,000,000.00	-4,371,548.72	-149,371,548.72
其中：1.基金申购款	40,000,000.00	-757,889.24	39,242,110.76
2.基金赎回款	-185,000,000.00	-3,613,659.48	-188,613,659.48
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	2,331,408,470.00	-53,590,606.16	2,277,817,863.84

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：

高阳

薄贺龙

薄贺龙

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

根据《天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2020]735号文审核同意,本基金333,908,470.00份基金份额于2020年8月24日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在0.2%以内,年化跟踪误差控制在2%以内。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。此外,为更好地实现基金的投资目标,本基金还可以投资于国内依法发行上市的非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票)、存托凭证、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、货币市场工具、同业存单、债券回购、资产支持证券、银行存款、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可以根据相关法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:本基金投资于标的指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%,且不低于非现金基金资产的80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证

金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：中证500指数收益率。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《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》、《天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2024年度上半年财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2024年06月30日的财务状况以及2024年度上半年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

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

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101

号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
----	--------------------

活期存款	14,457,620.90
等于：本金	14,451,064.81
加：应计利息	6,556.09
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	14,457,620.90

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	2,428,548,782.99	-	1,993,813,441.53	-434,735,341.46	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	372,000.00	27.72	372,027.72	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	372,000.00	27.72	372,027.72	-
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	

其他	-	-	-	-
合计	2,428,920,782.99	27.72	1,994,185,469.25	-434,735,341.46

注：1、股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

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

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	51,697,080.00	-	-	-
--股指期货	51,697,080.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	51,697,080.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2409	IC2409	50.00	48,752,000.00	-2,945,080.00
合计				-2,945,080.00
减：可抵销 期货暂收款				-2,945,080.00
净额				-

注：1、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
应收利息	-
其他应收款	65,907.53
待摊费用	75,409.12
合计	141,316.65

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	162,456.62
其中：交易所市场	162,456.62
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	139,233.64
其他应付款	161,238.88

合计	462,929.14
----	------------

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,481,408,470.00	2,481,408,470.00
本期申购	252,500,000.00	252,500,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-232,500,000.00	-232,500,000.00
本期末	2,501,408,470.00	2,501,408,470.00

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	162,296,173.03	-439,188,210.59	-276,892,037.56
本期期初	162,296,173.03	-439,188,210.59	-276,892,037.56
本期利润	-85,632,039.57	-80,511,152.44	-166,143,192.01
本期基金份额交易产生的变动数	1,800,612.07	-13,670,574.16	-11,869,962.09
其中：基金申购款	14,161,464.95	-56,889,926.08	-42,728,461.13
基金赎回款	-12,360,852.88	43,219,351.92	30,858,499.04
本期已分配利润	-	-	-
本期末	78,464,745.53	-533,369,937.19	-454,905,191.66

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-

结算备付金利息收入	6,862.02
其他	2,583.73
合计	163,616.93

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-85,955,979.85
股票投资收益——赎回差价收入	-20,266,441.09
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	-106,222,420.94

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
卖出股票成交总额	442,531,023.60
减：卖出股票成本总额	527,884,769.01
减：交易费用	602,234.44
买卖股票差价收入	-85,955,979.85

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
赎回基金份额对价总额	201,641,500.96
减：现金支付赎回款总额	100,423,197.96
减：赎回股票成本总额	121,484,744.09
减：交易费用	-

赎回差价收入	-20,266,441.09
--------	----------------

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
债券投资收益——利息收入	40.88
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	40,389.07
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	40,429.95

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	228,317.56
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	187,900.00
减：应计利息总额	19.36
减：交易费用	9.13
买卖债券差价收入	40,389.07

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期未取得资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期未取得贵金属投资收益。

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

本基金本报告期未取得买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
期货投资	-3,378,373.96

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	27,619,929.16
其中：证券出借权益补偿收入	3,590,094.95
基金投资产生的股利收益	-
合计	27,619,929.16

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
1.交易性金融资产	-79,586,432.44
——股票投资	-79,586,432.44
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-924,720.00
——权证投资	-

——期货投资	-924,720.00
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	-80,511,152.44

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
基金赎回费收入	-
基金转换费收入	-
ETF基金替代损益	869,623.22
合计	869,623.22

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内未发生信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	39,781.56
信息披露费	49,726.04
证券出借违约金	-
指数使用费	320,753.33
IOPV计算发布费	49,726.04
ETF登记结算费	74,590.88
存托服务费	656.84
合计	535,234.69

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
天弘基金管理有限公司	基金管理人
国泰君安证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	基金管理人的股东
天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金	本基金的联接基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023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
国泰君安 证券股份 有限公司	515,098,988.80	54.36%	13,851,276.35	1.72%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024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
国泰君安证券股份有限公司	127,311.56	39.76%	124,519.14	76.65%
关联方名称	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	3,205.66	0.93%	-	-

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

2、本报告期及上年度可比期间，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等。

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 2024年01月01日至20	上年度可比期间 2023年01月01日至20

	24年06月30日	23年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,345,889.02	5,882,388.91
其中：应支付销售机构的客户维护费	31,185.81	35,265.31
应支付基金管理人的净管理费	5,314,703.21	5,847,123.60

注:1、支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,069,177.82	1,176,477.78

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

单位：人民币元

本期 2024年01月01日至2024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

-	-	-	-	-
上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
国泰君安证券股份有限公司	440,928,905.00	286,722.23	-	-

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 2024年01月01日至2024年06月30日						
关联方名称	交易金额	费率区间(%)	加权平均费率(%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
国泰君安证券股份有限公司	2,514,102,360.00	1.10~2.00	1.60	1,305,324.29	118,341,014.60	33,978.64
上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日						
关联方名称	交易金额	费率区间(%)	加权平均费率(%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
国泰君安证券股份有限公司	200,982,722.00	2.16~6.01	2.82	129,277.16	121,058,291.58	22,826.82

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

本基金本报告期及上年度可比期间无基金管理人运用自有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024年06月30日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份

		额的比例		额的比例
天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金	2,384,187,969.00	95.31%	2,361,606,069.00	95.17%

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
国泰君安证券股份有限公司	14,457,620.90	154,171.18	18,574,945.99	151,331.91

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2024年01月01日至2024年06月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额
国泰君安证券股份有限公司	601033	永兴股份	网下申购	12,577	203,747.40
国泰君安证券股份有限公司	603082	北自科技	网下申购	1,070	22,769.60

有限公司					
国泰君安 证券股份 有限公司	301591	肯特股份	网下申购	2,184	42,435.12
国泰君安 证券股份 有限公司	603341	龙旗科技	网下申购	2,978	77,428.00
国泰君安 证券股份 有限公司	603285	键邦股份	网下申购	1,287	24,002.55
上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日					
关联方名 称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张 /股）	总金额
国泰君安 证券股份 有限公司	001314	亿道信息	网下申购	508	17,780.00
国泰君安 证券股份 有限公司	001311	多利科技	网下申购	499	30,873.13
国泰君安 证券股份 有限公司	603065	宿迁联盛	网下申购	581	7,465.85
国泰君安 证券股份 有限公司	603135	中重科技	网下申购	6,273	111,659.40
国泰君安 证券股份 有限公司	688479	友车科技	网下申购	3,318	112,778.82
国泰君安 证券股份 有限公司	688361	中科飞测	网下申购	8,303	195,950.80

国泰君安 证券股份 有限公司	688543	国科军工	网下申购	4,094	178,784.98
----------------------	--------	------	------	-------	------------

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期末，本基金（因追踪指数成份股而被动）持有君正集团的股票1,133,900股（上年度末：1,116,600股），估值总额为人民币4,184,091.00元（上年度末：4,176,084.00元），占基金净资产的比例为0.20%（上年度末：0.19%）。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2024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
301589	诺瓦星云	2024-02-01	6个月	创业板打新限售	126.89	188.01	691	87,680.99	129,914.91	-
301589	诺瓦星云	2024-05-30	3个月	锁定期送股	-	188.01	553	-	103,969.53	-
688692	达梦数据	2024-06-04	6个月	科创板打新限售	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
603285	键邦股份	2024-06-28	1个月内（含）	新股未上市	18.65	18.65	1,287	24,002.55	24,002.55	-
6033	安乃	2024	1个月内	新股	20.56	20.56	1,051	21,60	21,60	-

50	达	-06-26	(含)	未上市				8.56	8.56	
601033	永兴股份	2024-01-11	6个月	新股锁定	16.20	15.96	1,258	20,379.60	20,077.68	-
688709	成都华微	2024-01-31	6个月	科创板打新限售	15.69	18.79	1,045	16,396.05	19,635.55	-
301536	星辰科技	2024-03-20	6个月	创业板打新限售	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
688584	上海合晶	2024-02-01	6个月	科创板打新限售	22.66	15.89	866	19,623.56	13,760.74	-
301538	骏鼎达	2024-03-13	6个月	创业板打新限售	55.82	91.24	107	5,972.74	9,762.68	-
301538	骏鼎达	2024-05-22	4个月	锁定期送股	-	91.24	43	-	3,923.32	-
301565	中仑新材	2024-06-13	6个月	创业板打新限售	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-
301580	C爱迪特	2024-06-19	6个月	创业板打新限售	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-
603341	龙旗科技	2024-02-2	6个月	新股锁定	26.00	37.49	298	7,748.00	11,117.20	-

		3								
688691	灿芯股份	2024-04-02	6个月	科创板打新限售	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
301566	达利凯普	2023-12-22	6个月	创业板打新限售	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301392	汇成真空	2024-05-28	6个月	创业板打新限售	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301591	肯特股份	2024-02-20	6个月	创业板打新限售	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
301587	中瑞股份	2024-03-27	6个月	创业板打新限售	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
001389	广合科技	2024-03-26	6个月	新股锁定	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301539	宏鑫科技	2024-04-03	6个月	创业板打新限售	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
688695	中创股份	2024-03-06	6个月	科创板打新限售	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688530	欧莱新材	2024-04-2	6个月	科创板打	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-

		9		新限售						
301588	美新科技	2024-03-06	6个月	创业板打新限售	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301502	华阳智能	2024-01-26	6个月	创业板打新限售	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
603325	博隆技术	2024-01-03	6个月	新股锁定	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603381	C永臻	2024-06-19	6个月	新股锁定	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
603344	星德胜	2024-03-13	6个月	新股锁定	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
001359	平安电工	2024-03-19	6个月	新股锁定	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
603312	西典新能	2024-01-04	6个月	新股锁定	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603082	北自科技	2024-01-23	6个月	新股锁定	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
001379	腾达科技	2024-01-11	6个月	新股锁定	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
603375	盛景微	2024-01-17	6个月	新股锁定	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
001387	雪祺电气	2024-01-0	6个月	新股锁定	15.38	15.25	133	2,045.54	2,028.25	-

		4								
001387	雪祺电气	2024-06-03	2个月	锁定期送股	-	15.25	40	-	610.00	-

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
113685	升24转债	2024-06-14	1个月内（含）	新债未上市	100.00	100.01	3,720	372,000.00	372,027.72	-

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2024年06月30日，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2024年06月30日，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：股）	期末估值总额
1	000009	中国宝安	2024年07月03日-2024年07月12日	8.60	93,600	804,960.00

2	000021	深科技	2024年07月03日- 2024年07月12日	15.12	42,300	639,576.00
3	000027	深圳能源	2024年07月03日- 2024年07月12日	7.30	64,600	471,580.00
4	000031	大悦城	2024年07月03日- 2024年07月12日	2.34	58,300	136,422.00
5	000032	深桑达A	2024年07月03日- 2024年07月12日	14.98	20,500	307,090.00
6	000039	中集集团	2024年07月03日- 2024年07月12日	9.26	83,500	773,210.00
7	000050	深天马A	2024年07月03日- 2024年07月12日	7.28	55,600	404,768.00
8	000060	中金岭南	2024年07月03日- 2024年07月12日	4.24	118,700	503,288.00
9	000066	中国长城	2024年07月03日- 2024年07月12日	8.75	87,700	767,375.00
10	000155	川能动力	2024年07月03日- 2024年07月12日	10.77	36,800	396,336.00
11	000156	华数传媒	2024年07月03日- 2024年07月12日	6.28	41,900	263,132.00
12	000400	许继电气	2024年07月03日- 2024年07月12日	34.41	32,300	1,111,443.0 0
13	000401	冀东水泥	2024年07月03日- 2024年07月12日	4.06	48,000	194,880.00
14	000423	东阿阿胶	2024年07月03日- 2024年07月12日	62.60	19,700	1,233,220.0 0
15	000513	丽珠集团	2024年07月03日- 2024年07月12日	37.21	16,000	595,360.00
16	000519	中兵红箭	2024年07月03日- 2024年07月12日	14.67	37,800	554,526.00
17	000537	中绿电	2024年07月05日- 2024年07月12日	9.53	20,500	195,365.00

18	000539	粤电力 A	2024年07月03日- 2024年07月12日	5.08	40,200	204,216.00
19	000559	万向钱潮	2024年07月03日- 2024年07月12日	4.46	59,900	267,154.00
20	000563	陕国投 A	2024年07月03日- 2024年07月12日	2.75	139,200	382,800.00
21	000591	太阳能	2024年07月03日- 2024年07月12日	4.71	124,200	584,982.00
22	000598	兴蓉环境	2024年07月03日- 2024年07月12日	7.52	67,600	508,352.00
23	000623	吉林敖东	2024年07月03日- 2024年07月12日	13.40	43,200	578,880.00
24	000629	钒钛股份	2024年07月03日- 2024年07月12日	2.50	211,200	528,000.00
25	000630	铜陵有色	2024年07月03日- 2024年07月12日	3.61	348,700	1,258,807.0 0
26	000636	风华高科	2024年07月03日- 2024年07月12日	13.06	41,900	547,214.00
27	000683	远兴能源	2024年07月03日- 2024年07月12日	6.91	118,500	818,835.00
28	000703	恒逸石化	2024年07月03日- 2024年07月12日	7.09	99,700	706,873.00
29	000709	河钢股份	2024年07月03日- 2024年07月12日	1.94	187,700	364,138.00
30	000723	美锦能源	2024年07月03日- 2024年07月12日	4.76	117,700	560,252.00
31	000728	国元证券	2024年07月03日- 2024年07月12日	6.06	118,900	720,534.00
32	000729	燕京啤酒	2024年07月03日- 2024年07月12日	8.83	63,900	564,237.00
33	000738	航发控制	2024年07月03日- 2024年07月12日	20.07	35,500	712,485.00

34	000739	普洛药业	2024年07月03日- 2024年07月12日	13.57	26,300	356,891.00
35	000750	国海证券	2024年07月03日- 2024年07月12日	2.91	174,000	506,340.00
36	000778	新兴铸管	2024年07月03日- 2024年07月12日	3.48	108,500	377,580.00
37	000783	长江证券	2024年07月03日- 2024年07月12日	4.83	150,600	727,398.00
38	000818	航锦科技	2024年07月03日- 2024年07月12日	22.08	24,500	540,960.00
39	000825	太钢不锈	2024年07月03日- 2024年07月12日	3.38	103,700	350,506.00
40	000830	鲁西化工	2024年07月03日- 2024年07月12日	11.59	52,100	603,839.00
41	000831	中国稀土	2024年07月03日- 2024年07月12日	25.35	28,800	730,080.00
42	000878	云南铜业	2024年07月03日- 2024年07月12日	12.46	63,400	789,964.00
43	000883	湖北能源	2024年07月03日- 2024年07月12日	6.01	88,600	532,486.00
44	000887	中鼎股份	2024年07月03日- 2024年07月12日	12.24	35,800	438,192.00
45	000893	亚钾国际	2024年07月03日- 2024年07月12日	16.16	29,300	473,488.00
46	000898	鞍钢股份	2024年07月03日- 2024年07月12日	2.12	108,500	230,020.00
47	000921	海信家电	2024年07月03日- 2024年07月12日	32.24	20,900	673,816.00
48	000932	华菱钢铁	2024年07月03日- 2024年07月12日	4.43	188,300	834,169.00
49	000933	神火股份	2024年07月03日- 2024年07月12日	20.23	71,400	1,444,422.0 0

50	000937	冀中能源	2024年07月03日- 2024年07月12日	6.70	47,900	320,930.00
51	000958	电投产融	2024年07月03日- 2024年07月12日	3.66	73,100	267,546.00
52	000959	首钢股份	2024年07月03日- 2024年07月12日	2.72	70,500	191,760.00
53	000960	锡业股份	2024年07月03日- 2024年07月12日	15.49	44,500	689,305.00
54	000967	盈峰环境	2024年07月03日- 2024年07月12日	4.23	57,400	242,802.00
55	000987	越秀资本	2024年07月03日- 2024年07月12日	4.96	68,200	338,272.00
56	000988	华工科技	2024年07月03日- 2024年07月12日	29.93	45,500	1,361,815.0 0
57	000997	新大陆	2024年07月03日- 2024年07月12日	13.91	37,400	520,234.00
58	000998	隆平高科	2024年07月03日- 2024年07月12日	9.83	47,700	468,891.00
59	001286	陕西能源	2024年07月03日- 2024年07月12日	11.53	33,900	390,867.00
60	001872	招商港口	2024年07月03日- 2024年07月12日	19.25	9,600	184,800.00
61	002008	大族激光	2024年07月03日- 2024年07月12日	20.80	37,900	788,320.00
62	002019	亿帆医药	2024年07月03日- 2024年07月12日	12.36	33,300	411,588.00
63	002025	航天电器	2024年07月03日- 2024年07月12日	46.38	11,800	547,284.00
64	002028	思源电气	2024年07月03日- 2024年07月12日	66.90	27,800	1,859,820.0 0
65	002044	美年健康	2024年07月03日- 2024年07月12日	3.78	142,100	537,138.00

66	002056	横店东磁	2024年07月03日- 2024年07月12日	12.47	36,800	458,896.00
67	002064	华峰化学	2024年07月03日- 2024年07月12日	7.17	90,000	645,300.00
68	002065	东华软件	2024年07月03日- 2024年07月12日	4.52	101,900	460,588.00
69	002078	太阳纸业	2024年07月03日- 2024年07月12日	13.95	76,000	1,060,200.0 0
70	002080	中材科技	2024年07月03日- 2024年07月12日	12.90	30,300	390,870.00
71	002120	韵达股份	2024年07月03日- 2024年07月12日	7.74	65,600	507,744.00
72	002128	电投能源	2024年07月03日- 2024年07月12日	21.10	50,700	1,069,770.0 0
73	002138	顺络电子	2024年07月03日- 2024年07月12日	27.46	36,400	999,544.00
74	002152	广电运通	2024年07月03日- 2024年07月12日	10.46	56,100	586,806.00
75	002153	石基信息	2024年07月03日- 2024年07月12日	5.73	37,000	212,010.00
76	002155	湖南黄金	2024年07月03日- 2024年07月12日	18.10	37,900	685,990.00
77	002156	通富微电	2024年07月03日- 2024年07月12日	22.39	47,900	1,072,481.0 0
78	002185	华天科技	2024年07月03日- 2024年07月12日	8.15	116,200	947,030.00
79	002195	岩山科技	2024年07月03日- 2024年07月12日	2.51	258,100	647,831.00
80	002202	金风科技	2024年07月03日- 2024年07月12日	6.72	125,200	841,344.00
81	002203	海亮股份	2024年07月03日- 2024年07月12日	7.98	54,400	434,112.00

82	002223	鱼跃医疗	2024年07月03日- 2024年07月12日	37.60	27,100	1,018,960.0 0
83	002240	盛新锂能	2024年07月03日- 2024年07月12日	13.42	29,100	390,522.00
84	002244	滨江集团	2024年07月03日- 2024年07月12日	7.26	56,400	409,464.00
85	002261	拓维信息	2024年07月03日- 2024年07月12日	11.07	45,400	502,578.00
86	002262	恩华药业	2024年07月03日- 2024年07月12日	23.74	27,300	648,102.00
87	002266	浙富控股	2024年07月03日- 2024年07月12日	2.79	118,500	330,615.00
88	002273	水晶光电	2024年07月03日- 2024年07月12日	16.98	63,000	1,069,740.0 0
89	002281	光迅科技	2024年07月03日- 2024年07月12日	37.37	21,400	799,718.00
90	002294	信立泰	2024年07月03日- 2024年07月12日	26.63	25,000	665,750.00
91	002299	圣农发展	2024年07月03日- 2024年07月12日	13.64	33,600	458,304.00
92	002340	格林美	2024年07月03日- 2024年07月12日	6.37	233,200	1,485,484.0 0
93	002353	杰瑞股份	2024年07月03日- 2024年07月12日	35.08	27,600	968,208.00
94	002368	太极股份	2024年07月03日- 2024年07月12日	22.55	19,100	430,705.00
95	002372	伟星新材	2024年07月03日- 2024年07月12日	15.42	28,800	444,096.00
96	002373	千方科技	2024年07月03日- 2024年07月12日	9.07	42,900	389,103.00
97	002384	东山精密	2024年07月03日- 2024年07月12日	20.70	62,000	1,283,400.0 0

98	002385	大北农	2024年07月03日- 2024年07月12日	3.85	149,200	574,420.00
99	002407	多氟多	2024年07月03日- 2024年07月12日	12.23	54,000	660,420.00
100	002408	齐翔腾达	2024年07月03日- 2024年07月12日	5.60	64,400	360,640.00
101	002409	雅克科技	2024年07月03日- 2024年07月12日	62.91	12,400	780,084.00
102	002414	高德红外	2024年07月03日- 2024年07月12日	5.89	77,500	456,475.00
103	002423	中粮资本	2024年07月03日- 2024年07月12日	7.49	41,600	311,584.00
104	002429	兆驰股份	2024年07月03日- 2024年07月12日	4.81	102,600	493,506.00
105	002430	杭氧股份	2024年07月03日- 2024年07月12日	22.25	22,000	489,500.00
106	002432	九安医疗	2024年07月03日- 2024年07月12日	40.54	17,200	697,288.00
107	002436	兴森科技	2024年07月03日- 2024年07月12日	10.32	76,700	791,544.00
108	002439	启明星辰	2024年07月03日- 2024年07月12日	17.26	33,000	569,580.00
109	002444	巨星科技	2024年07月03日- 2024年07月12日	24.70	32,500	802,750.00
110	002465	海格通信	2024年07月03日- 2024年07月12日	10.36	78,700	815,332.00
111	002472	双环传动	2024年07月03日- 2024年07月12日	22.02	30,400	669,408.00
112	002487	大金重工	2024年07月03日- 2024年07月12日	22.88	16,800	384,384.00
113	002497	雅化集团	2024年07月03日- 2024年07月12日	8.92	52,100	464,732.00

11 4	002500	山西证券	2024年07月03日- 2024年07月12日	4.70	97,700	459,190.00
11 5	002506	协鑫集成	2024年07月03日- 2024年07月12日	1.94	212,600	412,444.00
11 6	002507	涪陵榨菜	2024年07月03日- 2024年07月12日	12.25	36,400	445,900.00
11 7	002508	老板电器	2024年07月03日- 2024年07月12日	22.10	21,400	472,940.00
11 8	002517	恺英网络	2024年07月03日- 2024年07月12日	9.55	97,600	932,080.00
11 9	002518	科士达	2024年07月03日- 2024年07月12日	17.70	9,600	169,920.00
12 0	002531	天顺风能	2024年07月03日- 2024年07月12日	8.94	40,600	362,964.00
12 1	002532	天山铝业	2024年07月03日- 2024年07月12日	8.11	126,700	1,027,537.0 0
12 2	002557	洽洽食品	2024年07月03日- 2024年07月12日	28.19	13,100	369,289.00
12 3	002558	巨人网络	2024年07月03日- 2024年07月12日	9.44	62,600	590,944.00
12 4	002563	森马服饰	2024年07月03日- 2024年07月12日	5.81	36,400	211,484.00
12 5	002568	百润股份	2024年07月03日- 2024年07月12日	16.83	23,500	395,505.00
12 6	002572	索菲亚	2024年07月03日- 2024年07月12日	15.33	25,900	397,047.00
12 7	002595	豪迈科技	2024年07月03日- 2024年07月12日	38.17	17,400	664,158.00
12 8	002607	中公教育	2024年07月03日- 2024年07月12日	1.53	196,100	300,033.00
12 9	002608	江苏国信	2024年07月03日- 2024年07月12日	7.75	27,200	210,800.00

130	002624	完美世界	2024年07月03日- 2024年07月12日	7.60	61,500	467,400.00
131	002625	光启技术	2024年07月03日- 2024年07月12日	17.35	68,500	1,188,475.00
132	002653	海思科	2024年07月03日- 2024年07月12日	30.70	14,500	445,150.00
133	002673	西部证券	2024年07月03日- 2024年07月12日	6.19	121,600	752,704.00
134	002683	广东宏大	2024年07月03日- 2024年07月12日	20.13	20,500	412,665.00
135	002690	美亚光电	2024年07月03日- 2024年07月12日	16.50	15,300	252,450.00
136	002738	中矿资源	2024年07月03日- 2024年07月12日	26.80	32,900	881,720.00
137	002739	万达电影	2024年07月03日- 2024年07月12日	12.09	69,000	834,210.00
138	002756	永兴材料	2024年07月03日- 2024年07月12日	35.78	16,400	586,792.00
139	002791	坚朗五金	2024年07月11日- 2024年07月12日	25.87	4,400	113,828.00
140	002797	第一创业	2024年07月03日- 2024年07月12日	5.09	152,600	776,734.00
141	002831	裕同科技	2024年07月03日- 2024年07月12日	25.59	16,300	417,117.00
142	002850	科达利	2024年07月03日- 2024年07月11日	76.38	3,500	267,330.00
143	002867	周大生	2024年07月03日- 2024年07月12日	13.06	19,200	250,752.00
144	002926	华西证券	2024年07月03日- 2024年07月12日	6.59	71,400	470,526.00
145	002936	郑州银行	2024年07月03日- 2024年07月12日	1.73	224,800	388,904.00

14 6	002939	长城证券	2024年07月03日- 2024年07月12日	6.70	73,100	489,770.00
14 7	002945	华林证券	2024年07月03日- 2024年07月12日	9.98	11,700	116,766.00
14 8	002958	青农商行	2024年07月03日- 2024年07月12日	2.68	201,800	540,824.00
14 9	002966	苏州银行	2024年07月03日- 2024年07月12日	7.50	133,100	998,250.00
15 0	002984	森麒麟	2024年07月03日- 2024年07月12日	24.09	27,800	669,702.00
15 1	003022	联泓新科	2024年07月03日- 2024年07月12日	13.71	17,400	238,554.00
15 2	003035	南网能源	2024年07月03日- 2024年07月12日	4.40	51,400	226,160.00
15 3	300001	特锐德	2024年07月03日- 2024年07月12日	20.12	33,400	672,008.00
15 4	300002	神州泰岳	2024年07月03日- 2024年07月12日	8.12	89,000	722,680.00
15 5	300003	乐普医疗	2024年07月03日- 2024年07月12日	14.84	59,500	882,980.00
15 6	300009	安科生物	2024年07月03日- 2024年07月12日	8.54	52,900	451,766.00
15 7	300012	华测检测	2024年07月03日- 2024年07月12日	10.06	76,300	767,578.00
15 8	300017	网宿科技	2024年07月03日- 2024年07月12日	7.90	110,600	873,740.00
15 9	300024	机器人	2024年07月03日- 2024年07月12日	9.74	56,100	546,414.00
16 0	300037	新宙邦	2024年07月03日- 2024年07月12日	28.56	23,800	679,728.00
16 1	300054	鼎龙股份	2024年07月03日- 2024年07月12日	22.68	33,900	768,852.00

16 2	300058	蓝色光标	2024年07月03日- 2024年07月12日	5.44	112,900	614,176.00
16 3	300070	碧水源	2024年07月03日- 2024年07月12日	4.19	98,700	413,553.00
16 4	300073	当升科技	2024年07月03日- 2024年07月12日	34.31	17,700	607,287.00
16 5	300088	长信科技	2024年07月03日- 2024年07月12日	4.70	111,400	523,580.00
16 6	300114	中航电测	2024年07月03日- 2024年07月12日	45.25	12,900	583,725.00
16 7	300118	东方日升	2024年07月03日- 2024年07月12日	12.10	41,300	499,730.00
16 8	300136	信维通信	2024年07月03日- 2024年07月12日	19.58	43,800	857,604.00
16 9	300144	宋城演艺	2024年07月03日- 2024年07月12日	8.03	71,200	571,736.00
17 0	300146	汤臣倍健	2024年07月03日- 2024年07月12日	13.55	46,200	626,010.00
17 1	300207	欣旺达	2024年07月03日- 2024年07月12日	15.17	67,400	1,022,458.0 0
17 2	300212	易华录	2024年07月03日- 2024年07月12日	16.83	18,900	318,087.00
17 3	300251	光线传媒	2024年07月03日- 2024年07月12日	8.41	66,500	559,265.00
17 4	300253	卫宁健康	2024年07月03日- 2024年07月12日	5.90	78,400	462,560.00
17 5	300285	国瓷材料	2024年07月03日- 2024年07月12日	17.85	36,000	642,600.00
17 6	300296	利亚德	2024年07月03日- 2024年07月12日	4.50	91,700	412,650.00
17 7	300357	我武生物	2024年07月03日- 2024年07月12日	20.22	13,600	274,992.00

178	300373	扬杰科技	2024年07月03日- 2024年07月12日	38.90	14,100	548,490.00
179	300383	光环新网	2024年07月03日- 2024年07月12日	8.45	65,100	550,095.00
180	300390	天华新能	2024年07月03日- 2024年07月12日	17.18	26,400	453,552.00
181	300394	天孚通信	2024年07月03日- 2024年07月12日	88.42	14,500	1,282,090.00
182	300395	菲利华	2024年07月03日- 2024年07月12日	30.75	23,400	719,550.00
183	300438	鹏辉能源	2024年07月03日- 2024年07月12日	18.34	15,300	280,602.00
184	300474	景嘉微	2024年07月03日- 2024年07月12日	63.23	12,000	758,760.00
185	300487	蓝晓科技	2024年07月03日- 2024年07月12日	41.76	10,400	434,304.00
186	300502	新易盛	2024年07月03日- 2024年07月12日	105.55	31,900	3,367,045.00
187	300529	健帆生物	2024年07月03日- 2024年07月12日	27.21	21,800	593,178.00
188	300558	贝达药业	2024年07月03日- 2024年07月12日	32.55	10,400	338,520.00
189	300567	精测电子	2024年07月03日- 2024年07月12日	56.51	5,400	305,154.00
190	300568	星源材质	2024年07月03日- 2024年07月12日	8.20	60,900	499,380.00
191	300595	欧普康视	2024年07月03日- 2024年07月12日	15.68	24,200	379,456.00
192	300601	康泰生物	2024年07月03日- 2024年07月12日	15.61	30,300	472,983.00
193	300604	长川科技	2024年07月03日- 2024年07月12日	27.17	16,400	445,588.00

19 4	300676	华大基因	2024年07月03日- 2024年07月12日	35.01	10,200	357,102.00
19 5	300677	英科医疗	2024年07月03日- 2024年07月12日	26.81	19,700	528,157.00
19 6	300682	朗新集团	2024年07月03日- 2024年07月12日	8.51	29,300	249,343.00
19 7	300699	光威复材	2024年07月03日- 2024年07月12日	24.83	26,200	650,546.00
19 8	300724	捷佳伟创	2024年07月03日- 2024年07月12日	54.01	12,000	648,120.00
19 9	300748	金力永磁	2024年07月03日- 2024年07月12日	12.96	30,900	400,464.00
20 0	300763	锦浪科技	2024年07月03日- 2024年07月12日	41.64	10,000	416,400.00
20 1	300765	新诺威	2024年07月03日- 2024年07月12日	25.23	18,300	461,709.00
20 2	300803	指南针	2024年07月03日- 2024年07月12日	36.41	10,100	367,741.00
20 3	300861	美畅股份	2024年07月03日- 2024年07月11日	19.35	4,100	79,335.00
20 4	300866	安克创新	2024年07月03日- 2024年07月12日	71.21	8,700	619,527.00
20 5	300888	稳健医疗	2024年07月03日- 2024年07月12日	25.30	9,600	242,880.00
20 6	301236	软通动力	2024年07月03日- 2024年07月12日	35.21	25,800	908,418.00
20 7	301267	华夏眼科	2024年07月03日- 2024年07月12日	20.72	10,400	215,488.00
20 8	301358	湖南裕能	2024年07月03日- 2024年07月12日	31.46	19,800	622,908.00
20 9	600004	白云机场	2024年07月03日- 2024年07月12日	9.48	53,600	508,128.00

21 0	600008	首创环保	2024年07月03日- 2024年07月12日	2.68	200,000	536,000.00
21 1	600021	上海电力	2024年07月03日- 2024年07月12日	9.89	63,800	630,982.00
21 2	600022	山东钢铁	2024年07月03日- 2024年07月12日	1.22	244,500	298,290.00
21 3	600032	浙江新能	2024年07月03日- 2024年07月12日	7.28	32,500	236,600.00
21 4	600038	中直股份	2024年07月03日- 2024年07月12日	41.11	15,900	653,649.00
21 5	600056	中国医药	2024年07月03日- 2024年07月12日	10.12	33,700	341,044.00
21 6	600060	海信视像	2024年07月03日- 2024年07月12日	24.74	35,400	875,796.00
21 7	600062	华润双鹤	2024年07月03日- 2024年07月12日	19.58	18,300	358,314.00
21 8	600066	宇通客车	2024年07月03日- 2024年07月12日	25.80	60,200	1,553,160.0 0
21 9	600079	人福医药	2024年07月03日- 2024年07月12日	17.17	51,700	887,689.00
22 0	600095	湘财股份	2024年07月03日- 2024年07月12日	5.96	38,800	231,248.00
22 1	600096	云天化	2024年07月03日- 2024年07月12日	19.42	58,100	1,128,302.0 0
22 2	600098	广州发展	2024年07月03日- 2024年07月12日	6.40	47,700	305,280.00
22 3	600109	国金证券	2024年07月03日- 2024年07月12日	7.55	118,000	890,900.00
22 4	600118	XD中国 卫	2024年07月03日- 2024年07月12日	22.23	26,600	591,318.00
22 5	600126	杭钢股份	2024年07月03日- 2024年07月12日	4.11	61,100	251,121.00

22 6	600129	太极集团	2024年07月03日- 2024年07月12日	28.92	16,900	488,748.00
22 7	600131	国网信通	2024年07月03日- 2024年07月12日	16.87	27,100	457,177.00
22 8	600141	兴发集团	2024年07月03日- 2024年07月12日	19.08	35,000	667,800.00
22 9	600143	金发科技	2024年07月03日- 2024年07月12日	6.61	84,700	559,867.00
23 0	600153	建发股份	2024年07月03日- 2024年07月12日	8.93	68,000	607,240.00
23 1	600155	华创云信	2024年07月03日- 2024年07月12日	5.91	102,500	605,775.00
23 2	600157	永泰能源	2024年07月03日- 2024年07月12日	1.18	1,010,300	1,192,154.0 0
23 3	600166	福田汽车	2024年07月03日- 2024年07月12日	2.25	218,200	490,950.00
23 4	600170	上海建工	2024年07月03日- 2024年07月12日	2.15	242,300	520,945.00
23 5	600177	雅戈尔	2024年07月03日- 2024年07月12日	7.12	126,200	898,544.00
23 6	600208	新湖中宝	2024年07月03日- 2024年07月12日	1.58	193,100	305,098.00
23 7	600258	XD首旅 酒	2024年07月03日- 2024年07月12日	12.35	30,300	374,205.00
23 8	600271	航天信息	2024年07月03日- 2024年07月12日	7.36	50,400	370,944.00
23 9	600282	南钢股份	2024年07月03日- 2024年07月12日	4.98	111,900	557,262.00
24 0	600298	安琪酵母	2024年07月03日- 2024年07月12日	27.93	27,400	765,282.00
24 1	600299	安迪苏	2024年07月03日- 2024年07月12日	9.70	17,600	170,720.00

24 2	600315	上海家化	2024年07月03日- 2024年07月12日	17.78	14,700	261,366.00
24 3	600316	洪都航空	2024年07月03日- 2024年07月12日	16.63	18,800	312,644.00
24 4	600325	华发股份	2024年07月03日- 2024年07月12日	6.50	74,900	486,850.00
24 5	600329	达仁堂	2024年07月03日- 2024年07月12日	32.39	12,400	401,636.00
24 6	600339	中油工程	2024年07月03日- 2024年07月12日	3.12	75,900	236,808.00
24 7	600348	华阳股份	2024年07月03日- 2024年07月12日	9.96	81,700	813,732.00
24 8	600350	山东高速	2024年07月03日- 2024年07月12日	8.85	30,500	269,925.00
24 9	600352	浙江龙盛	2024年07月03日- 2024年07月12日	8.59	118,100	1,014,479.0 0
25 0	600369	西南证券	2024年07月03日- 2024年07月12日	3.58	181,100	648,338.00
25 1	600373	中文传媒	2024年07月03日- 2024年07月12日	14.84	30,400	451,136.00
25 2	600377	宁沪高速	2024年07月03日- 2024年07月12日	12.60	22,300	280,980.00
25 3	600378	昊华科技	2024年07月03日- 2024年07月12日	28.90	11,800	341,020.00
25 4	600380	健康元	2024年07月03日- 2024年07月12日	11.17	50,700	566,319.00
25 5	600390	五矿资本	2024年07月03日- 2024年07月12日	4.05	102,100	413,505.00
25 6	600392	盛和资源	2024年07月03日- 2024年07月12日	8.62	63,400	546,508.00
25 7	600398	海澜之家	2024年07月03日- 2024年07月12日	9.24	109,100	1,008,084.0 0

25 8	600399	抚顺特钢	2024年07月03日- 2024年07月12日	5.63	71,500	402,545.00
25 9	600416	湘电股份	2024年07月03日- 2024年07月12日	9.94	42,000	417,480.00
26 0	600418	江淮汽车	2024年07月03日- 2024年07月12日	15.84	79,200	1,254,528.0 0
26 1	600435	XD北方 导	2024年07月03日- 2024年07月12日	8.62	47,500	409,450.00
26 2	600481	双良节能	2024年07月03日- 2024年07月12日	4.67	50,800	237,236.00
26 3	600483	福能股份	2024年07月03日- 2024年07月12日	11.66	34,700	404,602.00
26 4	600486	扬农化工	2024年07月03日- 2024年07月12日	56.45	10,100	570,145.00
26 5	600497	驰宏锌锗	2024年07月03日- 2024年07月12日	5.34	161,700	863,478.00
26 6	600498	烽火通信	2024年07月03日- 2024年07月12日	15.90	32,000	508,800.00
26 7	600499	科达制造	2024年07月03日- 2024年07月12日	8.43	60,800	512,544.00
26 8	600500	中化国际	2024年07月03日- 2024年07月12日	3.49	81,400	284,086.00
26 9	600511	国药股份	2024年07月03日- 2024年07月12日	30.79	16,400	504,956.00
27 0	600516	方大炭素	2024年07月03日- 2024年07月12日	4.31	128,000	551,680.00
27 1	600517	国网英大	2024年07月03日- 2024年07月12日	4.33	77,800	336,874.00
27 2	600521	华海药业	2024年07月03日- 2024年07月12日	17.05	39,800	678,590.00
27 3	600528	中铁工业	2024年07月03日- 2024年07月12日	7.32	50,400	368,928.00

27 4	600529	山东药玻	2024年07月03日- 2024年07月12日	25.34	29,900	757,666.00
27 5	600535	天士力	2024年07月03日- 2024年07月12日	12.58	40,500	509,490.00
27 6	600536	中国软件	2024年07月03日- 2024年07月12日	29.92	27,100	810,832.00
27 7	600546	山煤国际	2024年07月03日- 2024年07月12日	14.62	44,700	653,514.00
27 8	600549	厦门钨业	2024年07月03日- 2024年07月12日	17.25	38,400	662,400.00
27 9	600566	济川药业	2024年07月03日- 2024年07月12日	31.71	16,000	507,360.00
28 0	600578	京能电力	2024年07月03日- 2024年07月12日	3.24	91,100	295,164.00
28 1	600580	卧龙电驱	2024年07月03日- 2024年07月12日	12.15	41,500	504,225.00
28 2	600582	天地科技	2024年07月03日- 2024年07月12日	6.89	75,000	516,750.00
28 3	600583	海油工程	2024年07月03日- 2024年07月12日	5.91	100,200	592,182.00
28 4	600598	北大荒	2024年07月03日- 2024年07月12日	12.49	32,000	399,680.00
28 5	600612	老凤祥	2024年07月11日- 2024年07月12日	58.19	4,200	244,398.00
28 6	600637	东方明珠	2024年07月03日- 2024年07月12日	6.08	91,500	556,320.00
28 7	600642	申能股份	2024年07月03日- 2024年07月12日	8.83	88,700	783,221.00
28 8	600655	豫园股份	2024年07月03日- 2024年07月12日	5.15	88,500	455,775.00
28 9	600663	陆家嘴	2024年07月03日- 2024年07月12日	8.82	33,500	295,470.00

29 0	600673	东阳光	2024年07月03日- 2024年07月12日	7.04	68,300	480,832.00
29 1	600699	均胜电子	2024年07月03日- 2024年07月12日	14.82	44,500	659,490.00
29 2	600704	物产中大	2024年07月03日- 2024年07月12日	4.34	141,500	614,110.00
29 3	600707	彩虹股份	2024年07月03日- 2024年07月12日	6.81	65,000	442,650.00
29 4	600737	中粮糖业	2024年07月03日- 2024年07月12日	9.59	48,400	464,156.00
29 5	600739	辽宁成大	2024年07月03日- 2024年07月12日	8.37	48,400	405,108.00
29 6	600754	锦江酒店	2024年07月03日- 2024年07月12日	22.98	20,500	471,090.00
29 7	600755	厦门国贸	2024年07月03日- 2024年07月12日	7.17	59,900	429,483.00
29 8	600763	通策医疗	2024年07月03日- 2024年07月12日	54.05	9,100	491,855.00
29 9	600764	中国海防	2024年07月03日- 2024年07月12日	19.63	8,800	172,744.00
30 0	600765	中航重机	2024年07月03日- 2024年07月12日	20.40	46,900	956,760.00
30 1	600801	华新水泥	2024年07月03日- 2024年07月12日	13.75	30,300	416,625.00
30 2	600808	马钢股份	2024年07月03日- 2024年07月12日	2.02	109,100	220,382.00
30 3	600820	隧道股份	2024年07月03日- 2024年07月12日	6.53	99,800	651,694.00
30 4	600827	百联股份	2024年07月03日- 2024年07月12日	7.38	36,300	267,894.00
30 5	600839	四川长虹	2024年07月03日- 2024年07月12日	4.49	167,800	753,422.00

30 6	600848	上海临港	2024年07月03日- 2024年07月12日	9.11	43,400	395,374.00
30 7	600859	王府井	2024年07月03日- 2024年07月12日	11.74	35,900	421,466.00
30 8	600862	XD中航 高	2024年07月03日- 2024年07月12日	18.78	37,800	709,884.00
30 9	600863	内蒙华电	2024年07月03日- 2024年07月12日	4.64	148,100	687,184.00
31 0	600867	通化东宝	2024年07月03日- 2024年07月12日	8.37	62,900	526,473.00
31 1	600871	石化油服	2024年07月03日- 2024年07月12日	1.74	184,800	321,552.00
31 2	600872	中炬高新	2024年07月03日- 2024年07月12日	22.69	28,300	642,127.00
31 3	600873	梅花生物	2024年07月03日- 2024年07月12日	10.02	90,600	907,812.00
31 4	600879	航天电子	2024年07月03日- 2024年07月12日	7.77	119,800	930,846.00
31 5	600885	宏发股份	2024年07月03日- 2024年07月12日	27.68	37,700	1,043,536.0 0
31 6	600895	张江高科	2024年07月03日- 2024年07月12日	18.48	35,000	646,800.00
31 7	600901	江苏金租	2024年07月03日- 2024年07月12日	5.05	79,200	399,960.00
31 8	600906	财达证券	2024年07月03日- 2024年07月12日	5.73	58,800	336,924.00
31 9	600909	XD华安 证	2024年07月03日- 2024年07月12日	4.21	128,100	539,301.00
32 0	600928	西安银行	2024年07月03日- 2024年07月12日	3.27	60,400	197,508.00
32 1	600956	新天绿能	2024年07月03日- 2024年07月12日	8.17	13,500	110,295.00

32 2	600959	江苏有线	2024年07月03日- 2024年07月12日	2.64	136,200	359,568.00
32 3	600967	内蒙一机	2024年07月03日- 2024年07月12日	7.20	38,400	276,480.00
32 4	600968	海油发展	2024年07月03日- 2024年07月12日	4.12	92,100	379,452.00
32 5	600970	中材国际	2024年07月03日- 2024年07月12日	12.06	47,900	577,674.00
32 6	600977	中国电影	2024年07月03日- 2024年07月12日	10.76	33,800	363,688.00
32 7	600985	淮北矿业	2024年07月03日- 2024年07月12日	16.74	48,800	816,912.00
32 8	600988	赤峰黄金	2024年07月03日- 2024年07月12日	16.34	75,500	1,233,670.0 0
32 9	600995	南网储能	2024年07月03日- 2024年07月12日	9.66	43,400	419,244.00
33 0	600998	九州通	2024年07月03日- 2024年07月12日	4.88	114,400	558,272.00
33 1	601000	唐山港	2024年07月03日- 2024年07月12日	4.70	134,600	632,620.00
33 2	601016	节能风电	2024年07月03日- 2024年07月12日	2.99	176,300	527,137.00
33 3	601019	山东出版	2024年07月03日- 2024年07月12日	11.82	28,300	334,506.00
33 4	601058	赛轮轮胎	2024年07月03日- 2024年07月12日	14.00	119,400	1,671,600.0 0
33 5	601077	XD渝农 商	2024年07月03日- 2024年07月12日	5.02	281,400	1,412,628.0 0
33 6	601098	中南传媒	2024年07月03日- 2024年07月12日	12.42	32,400	402,408.00
33 7	601106	中国一重	2024年07月03日- 2024年07月12日	2.31	124,600	287,826.00

338	601108	财通证券	2024年07月03日- 2024年07月12日	6.61	147,600	975,636.00
339	601118	海南橡胶	2024年07月03日- 2024年07月12日	4.55	77,600	353,080.00
340	601128	常熟银行	2024年07月03日- 2024年07月12日	7.57	136,900	1,036,333.00
341	601139	深圳燃气	2024年07月03日- 2024年07月12日	6.68	25,900	173,012.00
342	601156	东航物流	2024年07月03日- 2024年07月12日	20.35	28,500	579,975.00
343	601158	重庆水务	2024年07月03日- 2024年07月12日	4.80	25,900	124,320.00
344	601162	天风证券	2024年07月03日- 2024年07月12日	2.18	315,100	686,918.00
345	601168	西部矿业	2024年07月03日- 2024年07月12日	17.95	75,600	1,357,020.00
346	601179	中国西电	2024年07月03日- 2024年07月12日	8.04	93,100	748,524.00
347	601198	东兴证券	2024年07月03日- 2024年07月12日	7.96	87,900	699,684.00
348	601212	白银有色	2024年07月03日- 2024年07月12日	2.78	134,500	373,910.00
349	601216	君正集团	2024年07月03日- 2024年07月12日	3.69	153,300	565,677.00
350	601228	广州港	2024年07月03日- 2024年07月12日	3.05	68,500	208,925.00
351	601231	环旭电子	2024年07月03日- 2024年07月12日	16.05	29,900	479,895.00
352	601233	桐昆股份	2024年07月03日- 2024年07月12日	15.96	76,600	1,222,536.00
353	601298	青岛港	2024年07月03日- 2024年07月12日	9.56	31,600	302,096.00

35 4	601399	国机重装	2024年07月03日- 2024年07月12日	2.58	131,000	337,980.00
35 5	601555	东吴证券	2024年07月03日- 2024年07月12日	5.90	180,600	1,065,540.0 0
35 6	601567	三星医疗	2024年07月03日- 2024年07月12日	35.00	31,800	1,113,000.0 0
35 7	601568	北元集团	2024年07月03日- 2024年07月12日	3.71	72,100	267,491.00
35 8	601577	长沙银行	2024年07月03日- 2024年07月12日	8.18	109,600	896,528.00
35 9	601598	中国外运	2024年07月03日- 2024年07月12日	5.63	71,500	402,545.00
36 0	601608	中信重工	2024年07月03日- 2024年07月12日	3.81	78,600	299,466.00
36 1	601611	中国核建	2024年07月03日- 2024年07月12日	8.09	54,600	441,714.00
36 2	601615	明阳智能	2024年07月03日- 2024年07月12日	9.44	82,500	778,800.00
36 3	601636	旗滨集团	2024年07月03日- 2024年07月12日	6.45	73,100	471,495.00
36 4	601665	齐鲁银行	2024年07月03日- 2024年07月12日	4.91	109,700	538,627.00
36 5	601666	平煤股份	2024年07月03日- 2024年07月12日	11.20	67,400	754,880.00
36 6	601696	中银证券	2024年07月03日- 2024年07月12日	9.08	75,600	686,448.00
36 7	601717	郑煤机	2024年07月03日- 2024年07月12日	14.80	48,900	723,720.00
36 8	601828	美凯龙	2024年07月03日- 2024年07月12日	2.55	48,900	124,695.00
36 9	601866	中远海发	2024年07月03日- 2024年07月12日	2.58	179,800	463,884.00

370	601880	辽港股份	2024年07月03日- 2024年07月12日	1.23	342,100	420,783.00
371	601928	凤凰传媒	2024年07月03日- 2024年07月12日	10.96	34,300	375,928.00
372	601933	永辉超市	2024年07月03日- 2024年07月12日	2.48	206,100	511,128.00
373	601958	金钼股份	2024年07月03日- 2024年07月12日	10.41	43,800	455,958.00
374	601965	中国汽研	2024年07月03日- 2024年07月12日	16.89	17,400	293,886.00
375	601966	玲珑轮胎	2024年07月03日- 2024年07月12日	18.37	33,300	611,721.00
376	601990	南京证券	2024年07月03日- 2024年07月12日	7.68	100,400	771,072.00
377	601991	大唐发电	2024年07月03日- 2024年07月12日	3.01	168,800	508,088.00
378	601992	金隅集团	2024年07月03日- 2024年07月12日	1.37	189,300	259,341.00
379	601997	贵阳银行	2024年07月03日- 2024年07月12日	5.27	132,700	699,329.00
380	603000	人民网	2024年07月03日- 2024年07月12日	19.99	24,900	497,751.00
381	603056	德邦股份	2024年07月03日- 2024年07月12日	13.10	13,500	176,850.00
382	603077	和邦生物	2024年07月03日- 2024年07月12日	1.65	281,000	463,650.00
383	603087	甘李药业	2024年07月03日- 2024年07月12日	46.32	13,100	606,792.00
384	603127	昭衍新药	2024年07月03日- 2024年07月12日	13.27	16,400	217,628.00
385	603156	养元饮品	2024年07月03日- 2024年07月12日	21.27	22,800	484,956.00

38 6	603160	汇顶科技	2024年07月03日- 2024年07月12日	68.75	12,000	825,000.00
38 7	603179	新泉股份	2024年07月03日- 2024年07月12日	39.24	15,000	588,600.00
38 8	603185	弘元绿能	2024年07月03日- 2024年07月12日	17.09	11,700	199,953.00
38 9	603218	日月股份	2024年07月03日- 2024年07月12日	10.27	23,100	237,237.00
39 0	603225	新凤鸣	2024年07月03日- 2024年07月12日	15.59	27,400	427,166.00
39 1	603228	景旺电子	2024年07月03日- 2024年07月12日	31.80	14,600	464,280.00
39 2	603233	大参林	2024年07月03日- 2024年07月12日	14.30	20,500	293,150.00
39 3	603290	斯达半导	2024年07月11日- 2024年07月12日	86.11	4,100	353,051.00
39 4	603298	杭叉集团	2024年07月03日- 2024年07月12日	19.64	23,500	461,540.00
39 5	603305	旭升集团	2024年07月03日- 2024年07月12日	10.56	16,300	172,128.00
39 6	603317	天味食品	2024年07月03日- 2024年07月12日	11.41	14,000	159,740.00
39 7	603338	浙江鼎力	2024年07月03日- 2024年07月12日	60.42	10,400	628,368.00
39 8	603345	安井食品	2024年07月03日- 2024年07月12日	74.31	8,400	624,204.00
39 9	603379	三美股份	2024年07月03日- 2024年07月12日	39.14	10,100	395,314.00
40 0	603456	九洲药业	2024年07月03日- 2024年07月12日	13.72	24,300	333,396.00
40 1	603486	科沃斯	2024年07月03日- 2024年07月12日	47.18	9,600	452,928.00

40 2	603517	绝味食品	2024年07月03日- 2024年07月12日	15.40	16,300	251,020.00
40 3	603529	爱玛科技	2024年07月05日- 2024年07月12日	27.33	8,100	221,373.00
40 4	603568	伟明环保	2024年07月03日- 2024年07月12日	20.58	23,000	473,340.00
40 5	603589	口子窖	2024年07月03日- 2024年07月12日	39.19	15,600	611,364.00
40 6	603596	伯特利	2024年07月03日- 2024年07月12日	38.90	18,600	723,540.00
40 7	603606	东方电缆	2024年07月03日- 2024年07月12日	48.81	18,000	878,580.00
40 8	603650	彤程新材	2024年07月03日- 2024年07月12日	29.55	9,900	292,545.00
40 9	603658	安图生物	2024年07月03日- 2024年07月12日	46.07	9,600	442,272.00
41 0	603688	石英股份	2024年07月03日- 2024年07月12日	29.61	11,700	346,437.00
41 1	603707	健友股份	2024年07月03日- 2024年07月12日	11.88	21,900	260,172.00
41 2	603712	七一二	2024年07月03日- 2024年07月12日	18.19	20,900	380,171.00
41 3	603737	三棵树	2024年07月03日- 2024年07月12日	36.27	8,700	315,549.00
41 4	603816	顾家家居	2024年07月03日- 2024年07月12日	32.29	22,200	716,838.00
41 5	603826	坤彩科技	2024年07月12日- 2024年07月12日	28.97	4,600	133,262.00
41 6	603858	步长制药	2024年07月03日- 2024年07月12日	15.15	24,900	377,235.00
41 7	603882	金城医学	2024年07月03日- 2024年07月12日	27.19	12,200	331,718.00

41 8	603883	老百姓	2024年07月03日- 2024年07月12日	18.36	19,350	355,266.00
41 9	603885	吉祥航空	2024年07月03日- 2024年07月12日	10.99	40,000	439,600.00
42 0	603927	中科软	2024年07月03日- 2024年07月12日	18.09	26,200	473,958.00
42 1	603939	益丰药房	2024年07月03日- 2024年07月12日	24.55	27,300	670,215.00
42 2	603979	金诚信	2024年07月03日- 2024年07月12日	50.53	16,300	823,639.00
42 3	605358	立昂微	2024年07月03日- 2024年07月12日	23.14	24,200	559,988.00
42 4	688017	绿的谐波	2024年07月11日- 2024年07月12日	82.10	3,300	270,930.00
42 5	688029	南微医学	2024年07月11日- 2024年07月12日	61.56	3,200	196,992.00
42 6	688052	纳芯微	2024年07月11日- 2024年07月12日	102.78	3,300	339,174.00
42 7	688063	派能科技	2024年07月11日- 2024年07月12日	39.71	5,900	234,289.00
42 8	688107	安路科技	2024年07月11日- 2024年07月12日	25.42	4,100	104,222.00
42 9	688120	华海清科	2024年07月11日- 2024年07月12日	189.58	3,200	606,656.00
43 0	688122	西部超导	2024年07月03日- 2024年07月12日	38.32	20,500	785,560.00
43 1	688169	石头科技	2024年07月11日- 2024年07月12日	392.60	3,000	1,177,800.0 0
43 2	688180	君实生物	2024年07月03日- 2024年07月12日	29.05	24,200	703,010.00
43 3	688234	天岳先进	2024年07月05日- 2024年07月12日	46.92	6,500	304,980.00

43 4	688248	南网科技	2024年07月05日- 2024年07月12日	29.63	6,500	192,595.00
43 5	688276	百克生物	2024年07月11日- 2024年07月12日	28.37	4,200	119,154.00
43 6	688295	中复神鹰	2024年07月11日- 2024年07月12日	20.30	3,300	66,990.00
43 7	688297	中无人机	2024年07月03日- 2024年07月12日	33.03	8,300	274,149.00
43 8	688331	荣昌生物	2024年07月05日- 2024年07月12日	43.20	6,700	289,440.00
43 9	688387	信科移动	2024年07月03日- 2024年07月12日	5.04	30,900	155,736.00
44 0	688390	固德威	2024年07月05日- 2024年07月12日	56.12	6,500	364,780.00
44 1	688425	铁建重工	2024年07月03日- 2024年07月12日	3.68	72,500	266,800.00
44 2	688475	萤石网络	2024年07月05日- 2024年07月12日	34.11	5,900	201,249.00
44 3	688516	奥特维	2024年07月05日- 2024年07月12日	41.81	5,900	246,679.00
44 4	688538	和辉光电	2024年07月03日- 2024年07月12日	1.98	188,800	373,824.00
44 5	688567	孚能科技	2024年07月03日- 2024年07月12日	9.60	33,000	316,800.00
44 6	688772	珠海冠宇	2024年07月03日- 2024年07月12日	14.90	30,400	452,960.00
44 7	688777	中控技术	2024年07月03日- 2024年07月12日	37.70	28,400	1,070,680.00
44 8	688778	厦钨新能	2024年07月05日- 2024年07月12日	31.24	6,500	203,060.00
44 9	688779	长远锂科	2024年07月03日- 2024年07月12日	4.63	43,500	201,405.00

450	688819	天能股份	2024年07月05日- 2024年07月12日	23.86	5,200	124,072.00
451	689009	九号公司	2024年07月03日- 2024年07月12日	36.81	22,500	828,225.00
合计	-	-	-	-	28,104,150	246,749,203.00

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是被动式投资的股票型指数基金，紧密跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似，本基金预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪标的指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但因特殊情况（比如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。本基金的基金管理人奉行全面风险管理理念，建立了以风险委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、内控合规部、风险管理部、内审部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在全面风险管理体系的框架下，董事会负责监督检查公司的合法合规运营、内部控制、风险管理，从而控制公司的整体运营风险。在董事会下设立风险委员会，负责审议风险管理的宏观政策，指导监督公司风险管理目标的落实等；在管理层层面设立风险管理委员会，主要负责指导、协调和监督各业务或职能部门开展风险管理工作；决定公司风险控制政策和程序，审批公司风险管理标准和重要业务风险管理口径；听取风险汇报，并就报告的重大风险管理事项进行决策；听取创新业务或产品风险评估报告；组织和协调重大风险事件的应对，直至风险得到妥善处理；审议公司重要的风险管理制度和流程。在业务操作层面风险管理职责主要由内控合规部和风险管理部负责，内控合规部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理提供合规控制标准，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；内控合规部对公司总经理负责，并由督察长分管。风险管理部通过投资交易系统的风控参数设置，保证各投资组合的投资比例合规；参与各投资组合新股申购、一级债申购、银行间交易等场外交易的风险识别与评估，保证各投资组合场外交易的事中合规控制；负责各投资组合投资绩效、大类风险的识别、计量和控制。风险管理部由督察长分管。内审部对公司内部控制和风险管理的有效性，经营效率和效果等方面开展独立评价活动，向总经理和督察长汇

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款和定期存款存放在本基金的托管人国泰君安证券股份有限公司开立于具有基金托管资格的银行的托管账户及其他具有基金托管资格的国有银行和大型股份制银行，并实施不同区间的额度管理，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近1年的分类结果为A类，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	372,027.72	163,905.03
未评级	-	-
合计	372,027.72	163,905.03

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

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

于2024年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的

15%。本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	14,457,620.90	-	-	-	14,457,620.90
结算备付金	364,939.26	-	-	32,376,495.99	32,741,435.25
存出保证金	384,450.20	-	-	5,850,240.00	6,234,690.20
交易性金融资产	-	-	372,027.72	1,993,813,441.53	1,994,185,469.25
应收清算款	-	-	-	3,221,554.72	3,221,554.72

应收股利	-	-	-	220,594.73	220,594.73
其他资产	-	-	-	141,316.65	141,316.65
资产总计	15,207,010.36	-	372,027.72	2,035,623,643.62	2,051,202,681.70
负债					
应付清算款	-	-	-	3,181,546.80	3,181,546.80
应付管理人报酬	-	-	-	866,198.06	866,198.06
应付托管费	-	-	-	173,239.65	173,239.65
应交税费	-	-	-	15,489.71	15,489.71
其他负债	-	-	-	462,929.14	462,929.14
负债总计	-	-	-	4,699,403.36	4,699,403.36
利率敏感度缺口	15,207,010.36	-	372,027.72	2,030,924,240.26	2,046,503,278.34
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	18,144,345.68	-	-	-	18,144,345.68
结算备付金	130,819.57	-	-	64,114,084.35	64,244,903.92
存出保证金	225,039.53	-	-	10,415,745.60	10,640,785.13
交易性金融资产	-	-	163,905.03	2,113,138,158.10	2,113,302,063.13
应收清算款	-	-	-	9,105,378.05	9,105,378.05
其他资产	-	-	-	132,673.59	132,673.59
资产总计	18,500,204.78	-	163,905.03	2,196,906,039.69	2,215,570,149.50
负债					
应付清算款	-	-	-	9,242,508.41	9,242,508.41
应付管理人报酬	-	-	-	923,303.65	923,303.65
应付托管费	-	-	-	184,660.74	184,660.74
应交税费	-	-	-	12,049.76	12,049.76
其他负债	-	-	-	691,194.50	691,194.50
负债总计	-	-	-	11,053,717.06	11,053,717.06
利率敏感度缺口	18,500,204.78	-	163,905.03	2,185,852,322.63	2,204,516,432.44

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2024年06月30日，本基金持有的交易性债券投资占基金净资产的比例为0.02%(2023年12月31日：0.01%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2023年12月31日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金原则上采用完全复制法，跟踪中证500指数，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金投资组合，并根据标的指数组成及其权重的变动而进行相应调整。但因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

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 2024年06月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,993,813,441.53	97.43	2,113,138,158.10	95.85
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	1,993,813,441.53	97.43	2,113,138,158.10	95.85

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注6.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	业绩比较基准上升5%	101,317,875.00	111,303,423.82
	业绩比较基准下降5%	-101,317,875.00	-111,303,423.82

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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	1,993,268,882.35	2,111,830,099.79

第二层次	417,638.83	163,905.03
第三层次	498,948.07	1,308,058.31
合计	1,994,185,469.25	2,113,302,063.13

6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的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2024年06月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2023年12月31日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	1,993,813,441.53	97.20
	其中：股票	1,993,813,441.53	97.20
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	372,027.72	0.02
	其中：债券	372,027.72	0.02

	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	47,199,056.15	2.30
8	其他各项资产	9,818,156.30	0.48
9	合计	2,051,202,681.70	100.00

注：本报告期末，本基金参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为246,749,203.00元，占基金资产净值的比例为12.06%。

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	12,495,617.00	0.61
B	采矿业	93,169,259.00	4.55
C	制造业	1,260,596,050.92	61.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	80,256,713.30	3.92
E	建筑业	20,290,379.00	0.99
F	批发和零售业	42,317,057.72	2.07
G	交通运输、仓储和邮政业	40,111,532.00	1.96
H	住宿和餐饮业	6,307,243.00	0.31
I	信息传输、软件和信息技术服务业	141,661,664.59	6.92
J	金融业	185,211,497.70	9.05
K	房地产业	22,541,369.00	1.10
L	租赁和商务服务业	15,216,350.00	0.74
M	科学研究和技术服务业	15,936,163.92	0.78
N	水利、环境和公共设施管	9,043,726.20	0.44

	理业		
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	2,218,806.00	0.11
Q	卫生和社会工作	12,364,047.00	0.60
R	文化、体育和娱乐业	29,968,462.00	1.46
S	综合	3,562,944.00	0.17
	合计	1,993,268,882.35	97.40

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	477,500.48	0.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	46,981.02	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	20,077.68	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	544,559.18	0.03

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	300502	新易盛	238,300	25,152,565.00	1.23
2	002028	思源电气	206,900	13,841,610.00	0.68
3	601058	赛轮轮胎	883,600	12,370,400.00	0.60
4	688169	石头科技	30,880	12,123,488.00	0.59
5	600066	宇通客车	446,300	11,514,540.00	0.56
6	002340	格林美	1,724,900	10,987,613.00	0.54
7	000933	神火股份	528,800	10,697,624.00	0.52
8	601077	XD渝农商	2,079,300	10,438,086.00	0.51
9	000988	华工科技	337,600	10,104,368.00	0.49
10	601168	西部矿业	560,400	10,059,180.00	0.49
11	300394	天孚通信	111,580	9,865,903.60	0.48
12	002384	东山精密	459,517	9,512,001.90	0.46
13	000423	东阿阿胶	151,600	9,490,160.00	0.46
14	000630	铜陵有色	2,578,000	9,306,580.00	0.45
15	600418	江淮汽车	586,800	9,294,912.00	0.45
16	600988	赤峰黄金	559,000	9,134,060.00	0.45
17	601233	桐昆股份	567,000	9,049,320.00	0.44
18	600157	永泰能源	7,462,300	8,805,514.00	0.43
19	002625	光启技术	506,500	8,787,775.00	0.43
20	600096	云天化	431,101	8,371,981.42	0.41

21	601567	三星医疗	236,900	8,291,500.00	0.41
22	000400	许继电气	239,400	8,237,754.00	0.40
23	688777	中控技术	212,200	7,999,940.00	0.39
24	002156	通富微电	355,900	7,968,601.00	0.39
25	002128	电投能源	376,500	7,944,150.00	0.39
26	002273	水晶光电	467,100	7,931,358.00	0.39
27	601555	东吴证券	1,335,270	7,878,093.00	0.38
28	002078	太阳纸业	563,300	7,858,035.00	0.38
29	600885	宏发股份	280,260	7,757,596.80	0.38
30	601128	常熟银行	1,012,650	7,665,760.50	0.37
31	002532	天山铝业	937,500	7,603,125.00	0.37
32	002223	鱼跃医疗	202,009	7,595,538.40	0.37
33	300207	欣旺达	500,300	7,589,551.00	0.37
34	600352	浙江龙盛	874,300	7,510,237.00	0.37
35	600398	海澜之家	806,500	7,452,060.00	0.36
36	002138	顺络电子	270,900	7,438,914.00	0.36
37	002966	苏州银行	985,289	7,389,667.50	0.36
38	002353	杰瑞股份	206,300	7,237,004.00	0.35
39	601108	财通证券	1,091,700	7,216,137.00	0.35
40	688617	惠泰医疗	15,600	7,115,160.00	0.35
41	600765	中航重机	348,440	7,108,176.00	0.35
42	002185	华天科技	860,990	7,017,068.50	0.34
43	002517	恺英网络	722,800	6,902,740.00	0.34
44	600879	航天电子	886,600	6,888,882.00	0.34
45	301236	软通动力	192,000	6,760,320.00	0.33
46	603606	东方电缆	138,500	6,760,185.00	0.33
47	600873	梅花生物	670,900	6,722,418.00	0.33
48	688099	晶晨股份	112,929	6,698,948.28	0.33
49	600177	雅戈尔	933,600	6,647,232.00	0.32
50	601577	长沙银行	810,400	6,629,072.00	0.32
51	600109	国金证券	873,000	6,591,150.00	0.32

52	600079	人福医药	383,800	6,589,846.00	0.32
53	002738	中矿资源	245,240	6,572,432.00	0.32
54	300003	乐普医疗	442,000	6,559,280.00	0.32
55	600060	海信视像	263,100	6,509,094.00	0.32
56	300017	网宿科技	819,700	6,475,630.00	0.32
57	600497	驰宏锌锗	1,197,000	6,391,980.00	0.31
58	300136	信维通信	324,900	6,361,542.00	0.31
59	603160	汇顶科技	92,300	6,345,625.00	0.31
60	603979	金诚信	124,400	6,285,932.00	0.31
61	002202	金风科技	927,500	6,232,800.00	0.30
62	002739	万达电影	512,300	6,193,707.00	0.30
63	689009	九号公司	168,000	6,184,080.00	0.30
64	000932	华菱钢铁	1,392,100	6,167,003.00	0.30
65	000683	远兴能源	877,100	6,060,761.00	0.30
66	600985	淮北矿业	362,000	6,059,880.00	0.30
67	688120	华海清科	31,950	6,057,081.00	0.30
68	600536	中国软件	202,098	6,046,772.16	0.30
69	002465	海格通信	583,655	6,046,665.80	0.30
70	600348	华阳股份	605,800	6,033,768.00	0.29
71	002409	雅克科技	95,900	6,033,069.00	0.29
72	002281	光迅科技	160,200	5,986,674.00	0.29
73	002444	巨星科技	242,258	5,983,772.60	0.29
74	000009	中国宝安	693,000	5,959,800.00	0.29
75	002008	大族激光	282,800	5,882,240.00	0.29
76	000878	云南铜业	471,100	5,869,906.00	0.29
77	002436	兴森科技	567,500	5,856,600.00	0.29
78	688122	西部超导	152,800	5,855,296.00	0.29
79	300474	景嘉微	92,460	5,846,245.80	0.29
80	600642	申能股份	657,600	5,806,608.00	0.28
81	601615	明阳智能	610,300	5,761,232.00	0.28
82	002797	第一创业	1,129,200	5,747,628.00	0.28

83	000039	中集集团	618,650	5,728,699.00	0.28
84	300054	鼎龙股份	252,200	5,719,896.00	0.28
85	601990	南京证券	742,900	5,705,472.00	0.28
86	600298	安琪酵母	204,200	5,703,306.00	0.28
87	000066	中国长城	650,200	5,689,250.00	0.28
88	300012	华测检测	565,260	5,686,515.60	0.28
89	600529	山东药玻	222,800	5,645,752.00	0.28
90	688525	佰维存储	87,500	5,613,125.00	0.27
91	601666	平煤股份	499,000	5,588,800.00	0.27
92	002673	西部证券	900,500	5,574,095.00	0.27
93	600839	四川长虹	1,240,600	5,570,294.00	0.27
94	603596	伯特利	142,540	5,544,806.00	0.27
95	601179	中国西电	688,700	5,537,148.00	0.27
96	000831	中国稀土	213,811	5,420,108.85	0.26
97	000783	长江证券	1,114,400	5,382,552.00	0.26
98	300395	菲利华	174,700	5,372,025.00	0.26
99	601717	郑煤机	362,700	5,367,960.00	0.26
100	603816	顾家家居	165,700	5,350,453.00	0.26
101	300002	神州泰岳	658,700	5,348,644.00	0.26
102	002432	九安医疗	131,600	5,335,064.00	0.26
103	000728	国元证券	879,500	5,329,770.00	0.26
104	000738	航发控制	265,100	5,320,557.00	0.26
105	600862	XD中航高	280,800	5,273,424.00	0.26
106	000703	恒逸石化	739,100	5,240,219.00	0.26
107	688180	君实生物	180,200	5,234,810.00	0.26
108	601198	东兴证券	651,500	5,185,940.00	0.25
109	601997	贵阳银行	982,300	5,176,721.00	0.25
110	603338	浙江鼎力	85,100	5,141,742.00	0.25
111	000960	锡业股份	331,500	5,134,935.00	0.25
112	603345	安井食品	69,100	5,134,821.00	0.25
113	002595	豪迈科技	134,300	5,126,231.00	0.25

114	002155	湖南黄金	282,700	5,116,870.00	0.25
115	688188	柏楚电子	27,576	5,089,150.80	0.25
116	600863	内蒙华电	1,096,100	5,085,904.00	0.25
117	601696	中银证券	559,900	5,083,892.00	0.25
118	601162	天风证券	2,328,700	5,076,566.00	0.25
119	300037	新宙邦	177,260	5,062,545.60	0.25
120	300866	安克创新	71,080	5,061,606.80	0.25
121	300724	捷佳伟创	93,600	5,055,336.00	0.25
122	600038	中直股份	122,800	5,048,308.00	0.25
123	600521	华海药业	295,600	5,039,980.00	0.25
124	000921	海信家电	155,900	5,026,216.00	0.25
125	002472	双环传动	227,100	5,000,742.00	0.24
126	300001	特锐德	248,400	4,997,808.00	0.24
127	603939	益丰药房	203,556	4,997,299.80	0.24
128	002984	森麒麟	207,100	4,989,039.00	0.24
129	002294	信立泰	187,300	4,987,799.00	0.24
130	600141	兴发集团	259,500	4,951,260.00	0.24
131	600549	厦门钨业	285,900	4,931,775.00	0.24
132	600699	均胜电子	331,100	4,906,902.00	0.24
133	002407	多氟多	400,820	4,902,028.60	0.24
134	600546	山煤国际	332,800	4,865,536.00	0.24
135	002850	科达利	63,700	4,865,406.00	0.24
136	300699	光威复材	195,440	4,852,775.20	0.24
137	600820	隧道股份	739,500	4,828,935.00	0.24
138	002262	恩华药业	203,000	4,819,220.00	0.24
139	600895	张江高科	260,200	4,808,496.00	0.23
140	301358	湖南裕能	152,800	4,807,088.00	0.23
141	600369	西南证券	1,339,000	4,793,620.00	0.23
142	002195	岩山科技	1,908,600	4,790,586.00	0.23
143	600872	中炬高新	211,000	4,787,590.00	0.23
144	300285	国瓷材料	268,008	4,783,942.80	0.23

145	002064	华峰化学	666,900	4,781,673.00	0.23
146	000021	深科技	314,000	4,747,680.00	0.23
147	603589	口子窖	120,900	4,738,071.00	0.23
148	603087	甘李药业	101,000	4,678,320.00	0.23
149	600021	上海电力	473,000	4,677,970.00	0.23
150	601000	唐山港	995,100	4,676,970.00	0.23
151	300073	当升科技	136,000	4,666,160.00	0.23
152	300146	汤臣倍健	342,900	4,646,295.00	0.23
153	600486	扬农化工	81,940	4,625,513.00	0.23
154	000513	丽珠集团	123,732	4,604,067.72	0.22
155	601966	玲珑轮胎	247,600	4,548,412.00	0.22
156	300058	蓝色光标	835,500	4,545,120.00	0.22
157	600704	物产中大	1,046,500	4,541,810.00	0.22
158	002756	永兴材料	126,700	4,533,326.00	0.22
159	600153	建发股份	504,400	4,504,292.00	0.22
160	603179	新泉股份	114,400	4,489,056.00	0.22
161	300114	中航电测	99,200	4,488,800.00	0.22
162	600155	华创云信	759,500	4,488,645.00	0.22
163	688065	凯赛生物	98,800	4,484,532.00	0.22
164	000830	鲁西化工	386,200	4,476,058.00	0.22
165	300529	健帆生物	162,800	4,429,788.00	0.22
166	600118	XD中国卫	198,600	4,414,878.00	0.22
167	600583	海油工程	742,500	4,388,175.00	0.21
168	002558	巨人网络	464,100	4,381,104.00	0.21
169	002152	广电运通	417,050	4,362,343.00	0.21
170	601156	东航物流	213,200	4,338,620.00	0.21
171	000591	太阳能	919,100	4,328,961.00	0.21
172	000623	吉林敖东	321,300	4,305,420.00	0.21
173	600970	中材国际	355,100	4,282,506.00	0.21
174	002025	航天电器	92,100	4,271,598.00	0.21
175	300373	扬杰科技	109,400	4,255,660.00	0.21

176	002385	大北农	1,104,800	4,253,480.00	0.21
177	002439	启明星辰	245,700	4,240,782.00	0.21
178	300144	宋城演艺	528,000	4,239,840.00	0.21
179	600380	健康元	376,200	4,202,154.00	0.21
180	601216	君正集团	1,133,900	4,184,091.00	0.20
181	000729	燕京啤酒	473,400	4,180,122.00	0.20
182	605358	立昂微	180,500	4,176,770.00	0.20
183	000723	美锦能源	871,800	4,149,768.00	0.20
184	600143	金发科技	627,600	4,148,436.00	0.20
185	300251	光线传媒	492,700	4,143,607.00	0.20
186	600998	九州通	846,903	4,132,886.64	0.20
187	600282	南钢股份	828,500	4,125,930.00	0.20
188	600637	东方明珠	677,500	4,119,200.00	0.20
189	000519	中兵红箭	280,600	4,116,402.00	0.20
190	300677	英科医疗	152,500	4,088,525.00	0.20
191	300383	光环新网	483,000	4,081,350.00	0.20
192	600516	方大炭素	946,700	4,080,277.00	0.20
193	600763	通策医疗	75,200	4,064,560.00	0.20
194	600392	盛和资源	471,100	4,060,882.00	0.20
195	000636	风华高科	310,800	4,059,048.00	0.20
196	300024	机器人	416,410	4,055,833.40	0.20
197	000818	航锦科技	182,500	4,029,600.00	0.20
198	002958	青农商行	1,493,100	4,001,508.00	0.20
199	601665	齐鲁银行	812,100	3,987,411.00	0.19
200	600909	XD华安证	947,010	3,986,912.10	0.19
201	002044	美年健康	1,051,600	3,975,048.00	0.19
202	600008	首创环保	1,479,050	3,963,854.00	0.19
203	000883	湖北能源	657,100	3,949,171.00	0.19
204	688213	思特威	81,405	3,948,142.50	0.19
205	600566	济川药业	123,700	3,922,527.00	0.19
206	000629	钒钛股份	1,561,000	3,902,500.00	0.19

207	601016	节能风电	1,304,470	3,900,365.30	0.19
208	600867	通化东宝	465,900	3,899,583.00	0.19
209	600511	国药股份	126,600	3,898,014.00	0.19
210	300088	长信科技	824,200	3,873,740.00	0.19
211	601456	国联证券	401,200	3,867,568.00	0.19
212	000997	新大陆	277,300	3,857,243.00	0.19
213	600170	上海建工	1,790,700	3,850,005.00	0.19
214	600582	天地科技	556,100	3,831,529.00	0.19
215	600499	科达制造	451,300	3,804,459.00	0.19
216	600498	烽火通信	238,800	3,796,920.00	0.19
217	600535	天士力	301,100	3,787,838.00	0.19
218	600129	太极集团	130,800	3,782,736.00	0.18
219	601933	永辉超市	1,523,800	3,779,024.00	0.18
220	000598	兴蓉环境	501,300	3,769,776.00	0.18
221	002120	韵达股份	487,000	3,769,380.00	0.18
222	600004	白云机场	397,500	3,768,300.00	0.18
223	601991	大唐发电	1,249,300	3,760,393.00	0.18
224	600580	卧龙电驱	308,200	3,744,630.00	0.18
225	000750	国海证券	1,286,700	3,744,297.00	0.18
226	002261	拓维信息	336,700	3,727,269.00	0.18
227	000060	中金岭南	878,600	3,725,264.00	0.18
228	603000	人民网	185,700	3,712,143.00	0.18
229	300567	精测电子	65,600	3,707,056.00	0.18
230	300118	东方日升	306,300	3,706,230.00	0.18
231	300568	星源材质	451,900	3,705,580.00	0.18
232	002430	杭氧股份	165,400	3,680,150.00	0.18
233	002429	兆驰股份	760,300	3,657,043.00	0.18
234	603486	科沃斯	77,500	3,656,450.00	0.18
235	002939	长城证券	542,100	3,632,070.00	0.18
236	603658	安图生物	78,800	3,630,316.00	0.18
237	600166	福田汽车	1,613,000	3,629,250.00	0.18

238	603156	养元饮品	170,100	3,618,027.00	0.18
239	600325	华发股份	554,600	3,604,900.00	0.18
240	603228	景旺电子	113,100	3,596,580.00	0.18
241	600816	建元信托	1,323,000	3,585,330.00	0.18
242	601231	环旭电子	222,700	3,574,335.00	0.17
243	300765	新诺威	141,400	3,567,522.00	0.17
244	600673	东阳光	506,100	3,562,944.00	0.17
245	300487	蓝晓科技	84,900	3,545,424.00	0.17
246	603568	伟明环保	171,890	3,537,496.20	0.17
247	603927	中科软	195,356	3,533,990.04	0.17
248	600754	锦江酒店	153,600	3,529,728.00	0.17
249	000893	亚钾国际	218,300	3,527,728.00	0.17
250	002508	老板电器	159,500	3,524,950.00	0.17
251	300601	康泰生物	225,000	3,512,250.00	0.17
252	000027	深圳能源	479,500	3,500,350.00	0.17
253	601636	旗滨集团	541,000	3,489,450.00	0.17
254	600563	法拉电子	45,800	3,489,044.00	0.17
255	002926	华西证券	528,800	3,484,792.00	0.17
256	000998	隆平高科	354,000	3,479,820.00	0.17
257	002624	完美世界	456,100	3,466,360.00	0.17
258	603298	杭叉集团	176,100	3,458,604.00	0.17
259	603290	斯达半导	40,100	3,453,011.00	0.17
260	002497	雅化集团	387,100	3,452,932.00	0.17
261	600737	中粮糖业	359,200	3,444,728.00	0.17
262	002653	海思科	112,206	3,444,724.20	0.17
263	688052	纳芯微	33,400	3,432,852.00	0.17
264	601866	中远海发	1,329,900	3,431,142.00	0.17
265	300604	长川科技	126,200	3,428,854.00	0.17
266	603077	和邦生物	2,076,200	3,425,730.00	0.17
267	300253	卫宁健康	580,480	3,424,832.00	0.17
268	002299	圣农发展	250,600	3,418,184.00	0.17

269	002056	横店东磁	273,300	3,408,051.00	0.17
270	002065	东华软件	753,900	3,407,628.00	0.17
271	688385	复旦微电	108,500	3,404,730.00	0.17
272	600131	国网信通	201,800	3,404,366.00	0.17
273	002500	山西证券	723,236	3,399,209.20	0.17
274	688002	睿创微纳	121,104	3,387,278.88	0.17
275	601958	金钼股份	325,100	3,384,291.00	0.17
276	300390	天华新能	196,930	3,383,257.40	0.17
277	688772	珠海冠宇	226,988	3,382,121.20	0.17
278	002414	高德红外	573,900	3,380,271.00	0.17
279	600373	中文传媒	227,500	3,376,100.00	0.16
280	600655	豫园股份	654,400	3,370,160.00	0.16
281	300009	安科生物	394,160	3,366,126.40	0.16
282	300763	锦浪科技	80,800	3,364,512.00	0.16
283	688114	华大智造	70,632	3,348,663.12	0.16
284	603893	瑞芯微	56,500	3,343,105.00	0.16
285	002507	涪陵榨菜	271,414	3,324,821.50	0.16
286	002368	太极股份	146,720	3,308,536.00	0.16
287	002372	伟星新材	213,876	3,297,967.92	0.16
288	600707	彩虹股份	482,200	3,283,782.00	0.16
289	601611	中国核建	405,500	3,280,495.00	0.16
290	603885	吉祥航空	297,500	3,269,525.00	0.16
291	000887	中鼎股份	265,400	3,248,496.00	0.16
292	002203	海亮股份	402,600	3,212,748.00	0.16
293	603379	三美股份	82,040	3,211,045.60	0.16
294	002831	裕同科技	125,000	3,198,750.00	0.16
295	603225	新凤鸣	204,800	3,192,832.00	0.16
296	600755	厦门国贸	444,300	3,185,631.00	0.16
297	688390	固德威	56,643	3,178,805.16	0.16
298	688521	芯原股份	118,100	3,159,175.00	0.15
299	600859	王府井	266,900	3,133,406.00	0.15

300	601880	辽港股份	2,529,400	3,111,162.00	0.15
301	600995	南网储能	321,900	3,109,554.00	0.15
302	600801	华新水泥	225,700	3,103,375.00	0.15
303	600329	达仁堂	95,800	3,102,962.00	0.15
304	600416	湘电股份	311,500	3,096,310.00	0.15
305	002683	广东宏大	153,200	3,083,916.00	0.15
306	600884	杉杉股份	379,400	3,080,728.00	0.15
307	300070	碧水源	730,500	3,060,795.00	0.15
308	600390	五矿资本	755,500	3,059,775.00	0.15
309	300296	利亚德	679,500	3,057,750.00	0.15
310	002019	亿帆医药	247,300	3,056,628.00	0.15
311	002506	协鑫集成	1,571,800	3,049,292.00	0.15
312	600435	XD北方导	353,000	3,042,860.00	0.15
313	002244	滨江集团	418,000	3,034,680.00	0.15
314	600483	福能股份	258,300	3,011,778.00	0.15
315	600739	辽宁成大	359,800	3,011,526.00	0.15
316	000050	深天马 A	412,600	3,003,728.00	0.15
317	300803	指南针	82,300	2,996,543.00	0.15
318	601098	中南传媒	241,200	2,995,704.00	0.15
319	300748	金力永磁	230,420	2,986,243.20	0.15
320	600399	抚顺特钢	529,800	2,982,774.00	0.15
321	600598	北大荒	238,700	2,981,363.00	0.15
322	601598	中国外运	529,500	2,981,085.00	0.15
323	002572	索菲亚	194,100	2,975,553.00	0.15
324	002568	百润股份	176,400	2,968,812.00	0.15
325	600901	江苏金租	587,300	2,965,865.00	0.14
326	000155	川能动力	273,500	2,945,595.00	0.14
327	002487	大金重工	128,400	2,937,792.00	0.14
328	300676	华大基因	83,800	2,933,838.00	0.14
329	600848	上海临港	321,600	2,929,776.00	0.14
330	002080	中材科技	225,400	2,907,660.00	0.14

331	002240	盛新锂能	216,600	2,906,772.00	0.14
332	001286	陕西能源	252,100	2,906,713.00	0.14
333	002373	千方科技	318,500	2,888,795.00	0.14
334	002557	洽洽食品	102,140	2,879,326.60	0.14
335	002936	郑州银行	1,663,120	2,877,197.60	0.14
336	000563	陕国投 A	1,031,000	2,835,250.00	0.14
337	300595	欧普康视	180,800	2,834,944.00	0.14
338	603712	七一二	155,700	2,832,183.00	0.14
339	002268	电科网安	198,800	2,828,924.00	0.14
340	600968	海油发展	683,000	2,813,960.00	0.14
341	603858	步长制药	185,700	2,813,355.00	0.14
342	601928	凤凰传媒	256,600	2,812,336.00	0.14
343	603883	老百姓	152,926	2,807,721.36	0.14
344	000778	新兴铸管	803,800	2,797,224.00	0.14
345	688017	绿的谐波	33,900	2,783,190.00	0.14
346	600258	XD首旅酒	224,900	2,777,515.00	0.14
347	688538	和辉光电	1,396,694	2,765,454.12	0.14
348	601212	白银有色	994,700	2,765,266.00	0.14
349	688301	奕瑞科技	23,932	2,757,684.36	0.13
350	600271	航天信息	373,300	2,747,488.00	0.13
351	300558	贝达药业	84,400	2,747,220.00	0.13
352	600062	华润双鹤	139,600	2,733,368.00	0.13
353	600528	中铁工业	373,100	2,731,092.00	0.13
354	688234	天岳先进	57,600	2,702,592.00	0.13
355	600977	中国电影	250,900	2,699,684.00	0.13
356	002531	天顺风能	301,800	2,698,092.00	0.13
357	603688	石英股份	91,000	2,694,510.00	0.13
358	601155	新城控股	303,700	2,693,819.00	0.13
359	000709	河钢股份	1,388,500	2,693,690.00	0.13
360	002408	齐翔腾达	477,380	2,673,328.00	0.13
361	688220	翱捷科技	71,200	2,667,152.00	0.13

362	688005	容百科技	114,500	2,665,560.00	0.13
363	000739	普洛药业	196,300	2,663,791.00	0.13
364	600959	江苏有线	1,007,400	2,659,536.00	0.13
365	600378	昊华科技	91,900	2,655,910.00	0.13
366	601118	海南橡胶	575,000	2,616,250.00	0.13
367	688536	思瑞浦	26,585	2,600,278.85	0.13
368	000825	太钢不锈	768,200	2,596,516.00	0.13
369	603444	吉比特	14,500	2,581,145.00	0.13
370	603737	三棵树	70,940	2,572,993.80	0.13
371	603882	金域医学	94,500	2,569,455.00	0.13
372	688331	荣昌生物	59,400	2,566,080.00	0.13
373	600056	中国医药	251,041	2,540,534.92	0.12
374	000987	越秀资本	505,430	2,506,932.80	0.12
375	601399	国机重装	969,200	2,500,536.00	0.12
376	600906	财达证券	436,000	2,498,280.00	0.12
377	600517	国网英大	576,400	2,495,812.00	0.12
378	603456	九洲药业	181,300	2,487,436.00	0.12
379	688200	华峰测控	27,103	2,486,700.25	0.12
380	601019	山东出版	210,200	2,484,564.00	0.12
381	600612	老凤祥	42,500	2,473,075.00	0.12
382	300212	易华录	145,880	2,455,160.40	0.12
383	002266	浙富控股	876,500	2,445,435.00	0.12
384	600316	洪都航空	144,400	2,401,372.00	0.12
385	000937	冀中能源	356,300	2,387,210.00	0.12
386	603650	彤程新材	80,700	2,384,685.00	0.12
387	600871	石化油服	1,367,700	2,379,798.00	0.12
388	603529	爱玛科技	86,900	2,374,977.00	0.12
389	688567	孚能科技	246,344	2,364,902.40	0.12
390	600925	苏能股份	462,800	2,337,140.00	0.11
391	002423	中粮资本	309,400	2,317,406.00	0.11
392	000032	深桑达 A	153,100	2,293,438.00	0.11

393	688063	派能科技	57,460	2,281,736.60	0.11
394	603728	鸣志电器	56,700	2,281,041.00	0.11
395	001227	兰州银行	956,500	2,276,470.00	0.11
396	601965	中国汽研	134,700	2,275,083.00	0.11
397	600098	广州发展	354,000	2,265,600.00	0.11
398	600208	新湖中宝	1,428,700	2,257,346.00	0.11
399	601298	青岛港	235,300	2,249,468.00	0.11
400	688297	中无人机	67,900	2,242,737.00	0.11
401	601608	中信重工	582,900	2,220,849.00	0.11
402	002607	中公教育	1,450,200	2,218,806.00	0.11
403	600022	山东钢铁	1,809,000	2,206,980.00	0.11
404	002670	国盛金控	260,200	2,203,894.00	0.11
405	688516	奥特维	52,696	2,203,219.76	0.11
406	600663	陆家嘴	249,600	2,201,472.00	0.11
407	688561	奇安信	92,700	2,189,574.00	0.11
408	603233	大参林	153,100	2,189,330.00	0.11
409	600578	京能电力	674,300	2,184,732.00	0.11
410	300438	鹏辉能源	118,300	2,169,622.00	0.11
411	300357	我武生物	105,500	2,133,210.00	0.10
412	300776	帝尔激光	46,340	2,129,786.40	0.10
413	601106	中国一重	921,200	2,127,972.00	0.10
414	003031	中瓷电子	45,880	2,121,491.20	0.10
415	600500	中化国际	602,600	2,103,074.00	0.10
416	600377	宁沪高速	166,700	2,100,420.00	0.10
417	002865	钧达股份	54,100	2,076,358.00	0.10
418	600967	内蒙一机	285,900	2,058,480.00	0.10
419	000785	居然之家	844,900	2,053,107.00	0.10
420	688349	三一重能	82,018	2,037,327.12	0.10
421	600315	上海家化	113,500	2,018,030.00	0.10
422	600350	山东高速	227,500	2,013,375.00	0.10
423	300888	稳健医疗	79,060	2,000,218.00	0.10

424	600827	百联股份	269,600	1,989,648.00	0.10
425	000958	电投产融	542,600	1,985,916.00	0.10
426	000537	中绿电	208,200	1,984,146.00	0.10
427	000559	万向钱潮	443,860	1,979,615.60	0.10
428	688425	铁建重工	537,768	1,978,986.24	0.10
429	601568	北元集团	533,350	1,978,728.50	0.10
430	002608	江苏国信	254,000	1,968,500.00	0.10
431	002690	美亚光电	118,490	1,955,085.00	0.10
432	000156	华数传媒	311,200	1,954,336.00	0.10
433	688029	南微医学	31,465	1,936,985.40	0.09
434	603707	健友股份	162,991	1,936,333.08	0.09
435	603826	坤彩科技	66,520	1,927,084.40	0.09
436	002867	周大生	147,450	1,925,697.00	0.09
437	603517	绝味食品	124,910	1,923,614.00	0.09
438	601992	金隅集团	1,399,900	1,917,863.00	0.09
439	688032	禾迈股份	16,539	1,898,346.42	0.09
440	600126	杭钢股份	454,100	1,866,351.00	0.09
441	300682	朗新集团	218,800	1,861,988.00	0.09
442	003022	联泓新科	134,500	1,843,995.00	0.09
443	000967	盈峰环境	426,900	1,805,787.00	0.09
444	688475	萤石网络	52,744	1,799,097.84	0.09
445	603218	日月股份	173,200	1,778,764.00	0.09
446	600032	浙江新能	242,200	1,763,216.00	0.09
447	688778	厦钨新能	56,400	1,761,936.00	0.09
448	600481	双良节能	377,100	1,761,057.00	0.09
449	688520	神州细胞	44,746	1,760,755.10	0.09
450	600361	XD创新新	436,600	1,759,498.00	0.09
451	600339	中油工程	562,500	1,755,000.00	0.09
452	301267	华夏眼科	84,700	1,754,984.00	0.09
453	603786	科博达	27,100	1,738,465.00	0.08
454	600095	湘财股份	288,000	1,716,480.00	0.08

455	000898	鞍钢股份	803,100	1,702,572.00	0.08
456	603127	昭衍新药	127,116	1,686,829.32	0.08
457	688248	南网科技	56,600	1,677,058.00	0.08
458	003035	南网能源	381,100	1,676,840.00	0.08
459	688281	华秦科技	19,600	1,633,072.00	0.08
460	600808	马钢股份	808,300	1,632,766.00	0.08
461	002563	森马服饰	271,600	1,577,996.00	0.08
462	002153	石基信息	275,172	1,576,735.56	0.08
463	603185	弘元绿能	91,300	1,560,317.00	0.08
464	601228	广州港	506,900	1,546,045.00	0.08
465	000539	粤电力A	299,100	1,519,428.00	0.07
466	001872	招商港口	78,000	1,501,500.00	0.07
467	688779	长远锂科	323,957	1,499,920.91	0.07
468	600928	西安银行	448,100	1,465,287.00	0.07
469	001203	大中矿业	152,100	1,461,681.00	0.07
470	000401	冀东水泥	357,300	1,450,638.00	0.07
471	688006	杭可科技	82,243	1,435,140.35	0.07
472	000959	首钢股份	523,700	1,424,464.00	0.07
473	600764	中国海防	71,800	1,409,434.00	0.07
474	002518	科士达	78,800	1,394,760.00	0.07
475	603056	德邦股份	103,400	1,354,540.00	0.07
476	603305	旭升集团	125,300	1,323,168.00	0.06
477	688172	燕东微	81,600	1,320,288.00	0.06
478	600299	安迪苏	135,100	1,310,470.00	0.06
479	601139	深圳燃气	193,100	1,289,908.00	0.06
480	300861	美畅股份	64,700	1,251,945.00	0.06
481	603317	天味食品	107,168	1,222,786.88	0.06
482	688276	百克生物	41,664	1,182,007.68	0.06
483	688387	信科移动	229,482	1,156,589.28	0.06
484	301029	怡合达	58,540	1,150,896.40	0.06
485	688375	国博电子	16,100	1,137,304.00	0.06

486	002791	坚朗五金	43,000	1,112,410.00	0.05
487	600927	永安期货	97,700	1,089,355.00	0.05
488	688819	天能股份	45,600	1,088,016.00	0.05
489	688153	唯捷创芯	27,900	1,032,300.00	0.05
490	688107	安路科技	40,353	1,025,773.26	0.05
491	601858	中国科传	53,500	1,022,920.00	0.05
492	000031	大悦城	432,000	1,010,880.00	0.05
493	601158	重庆水务	193,500	928,800.00	0.05
494	601828	美凯龙	364,000	928,200.00	0.05
495	002945	华林证券	90,700	905,186.00	0.04
496	688348	昱能科技	15,000	885,000.00	0.04
497	600956	新天绿能	103,300	843,961.00	0.04
498	301165	锐捷网络	22,800	680,352.00	0.03
499	688295	中复神鹰	33,092	671,767.60	0.03
500	603868	飞科电器	16,000	614,400.00	0.03

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	301589	诺瓦星云	1,244	233,884.44	0.01
2	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
3	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
4	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
5	601033	永兴股份	1,258	20,077.68	0.00
6	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
7	301536	星宸科技	481	15,521.87	0.00
8	688584	上海合晶	866	13,760.74	0.00
9	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
10	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00

11	301580	C爱迪特	202	13,317.86	0.00
12	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
13	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
14	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
15	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
16	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
17	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
18	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
19	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
20	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
21	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
22	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
23	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
24	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
25	603381	C永臻	178	4,473.14	0.00
26	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
27	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
28	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
29	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
30	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
31	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
32	001387	雪祺电气	173	2,638.25	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	688777	中控技术	9,280,084.70	0.42
2	601567	三星医疗	8,077,182.00	0.37

3	688617	惠泰医疗	7,074,905.96	0.32
4	002202	金风科技	6,834,056.00	0.31
5	601615	明阳智能	6,525,513.00	0.30
6	603979	金诚信	6,472,126.00	0.29
7	002436	兴森科技	6,433,479.00	0.29
8	301358	湖南裕能	6,101,406.00	0.28
9	000921	海信家电	5,953,985.00	0.27
10	300002	神州泰岳	5,952,138.00	0.27
11	300054	鼎龙股份	5,829,104.00	0.26
12	603345	安井食品	5,682,725.00	0.26
13	600872	中炬高新	5,614,041.00	0.25
14	002984	森麒麟	5,190,179.00	0.24
15	688525	佰维存储	5,082,392.11	0.23
16	603179	新泉股份	4,941,583.00	0.22
17	603087	甘李药业	4,867,664.00	0.22
18	000818	航锦科技	4,642,087.00	0.21
19	688065	凯赛生物	4,641,950.28	0.21
20	600763	通策医疗	4,583,913.88	0.21

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002463	沪电股份	15,776,638.00	0.72
2	002422	科伦药业	14,371,837.00	0.65
3	600160	巨化股份	11,837,091.87	0.54
4	000975	山金国际	11,825,442.92	0.54
5	300418	昆仑万维	10,340,771.00	0.47

6	600161	天坛生物	9,987,154.40	0.45
7	600415	小商品城	8,860,719.00	0.40
8	600482	中国动力	8,131,524.00	0.37
9	688072	拓荆科技	7,373,354.07	0.33
10	002600	领益智造	5,191,732.00	0.24
11	688728	格科微	4,287,744.93	0.19
12	002131	利欧股份	3,594,546.00	0.16
13	002032	苏泊尔	3,267,884.00	0.15
14	601168	西部矿业	3,253,262.00	0.15
15	000581	威孚高科	3,087,760.00	0.14
16	000547	航天发展	2,979,987.00	0.14
17	601778	晶科科技	2,968,658.00	0.13
18	300026	红日药业	2,849,630.00	0.13
19	688208	道通科技	2,810,008.70	0.13
20	002092	ST中泰	2,787,423.10	0.13

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	507,092,176.57
卖出股票收入（成交）总额	442,531,023.60

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-

4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	372,027.72	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	372,027.72	0.02

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	113685	升24转债	3,720	372,027.72	0.02

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

在实际进行投资运作时，由于ETF基金一般需要满仓操作，同时基金需要备出一定的现金头存应对申赎及费用等支付，因此仓位无法达到100%，这时基金仓位就存在裸露风险，通过套期保值方式买入期货合约，可以使基金仓位达到100%，避免仓位暴露的风险。股指期货在买入时总持仓量采用双限制策略，一是限制基金组合中总的股指期货持仓量不能超过向中金所申请并获批的套保总量；二是限制基金组合持有的股指期货合约价值加上基金组合中其他有价证券市值占基金净资产的比例不能超过法规规定的上限，并在股指期货的交易过程中严格遵守基金合同的约束和中金所的规定。根据本基金的基金合同、投资范围、投资目标、投资策略以及对市场走势研判的基础上，结合基金日常的申购赎回情况，制定套期保值交易的合理期限。套期保值的期限一般不超过股指期货当前的最远到期日合约，即次季合约。按照交易月份相近的原则，综合考虑并动态跟踪

不同到期日的期货合约的流动性、价差状况和展期风险等因素，选择合适月份的期货合约进行开仓和展期交易来实现远期套保的目的。另外对于交割月的股指期货，通常情况下，最晚在合约交割日进行平仓，尽量避免进行交割。在未来的股指期货交易过程中，本基金将严格遵守《证券投资基金参与股指期货交易指引》，以及中国金融期货交易所颁布的《中国金融期货交易所交易规则》、《中国金融期货交易所套期保值与套利交易管理办法》等相关规定，以套期保值为主要目的参与股指期货，严格控制交易中的各种风险。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	6,234,690.20
2	应收清算款	3,221,554.72
3	应收股利	220,594.73
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	65,907.53
7	待摊费用	75,409.12
8	其他	-
9	合计	9,818,156.30

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300502	新易盛	3,367,045.00	0.16	转融通证券出借
2	002028	思源电气	1,859,820.00	0.09	转融通证券出借
3	601058	赛轮轮胎	1,671,600.00	0.08	转融通证券出借
4	600066	宇通客车	1,553,160.00	0.08	转融通证券出借
5	002340	格林美	1,485,484.00	0.07	转融通证券出借
6	000933	神火股份	1,444,422.00	0.07	转融通证券出借
7	601077	XD渝农商	1,412,628.00	0.07	转融通证券出借
8	000988	华工科技	1,361,815.00	0.07	转融通证券出借
9	601168	西部矿业	1,357,020.00	0.07	转融通证券出借
10	688169	石头科技	1,177,800.00	0.06	转融通证券出借

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	301589	诺瓦星云	233,884.44	0.01	创业板打新限售
2	688692	达梦数据	30,612.75	0.00	科创板打新限售
3	603285	键邦股份	24,002.55	0.00	新股未上市
4	603350	安乃达	21,608.56	0.00	新股未上市
5	601033	永兴股份	20,077.68	0.00	新股锁定

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息**8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		联接基金	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
4,776	523,745.49	19,676,167.00	0.79%	97,544,334.00	3.90%	2,384,187,969.00	95.31%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总 份额比例
1	中国国际金融股份有限公司	10,556,359.00	0.42%
2	赵梦野	3,700,000.00	0.15%
3	广发证券股份有限公司	2,375,005.00	0.09%
4	中信建投证券股份有限公司	2,282,666.00	0.09%
5	张如依	2,045,100.00	0.08%
6	李艳东	2,000,000.00	0.08%
7	黄永耀	1,582,700.00	0.06%
8	赵中相	1,500,000.00	0.06%
9	郭晨凯	1,432,100.00	0.06%
10	刘国胜	1,324,700.00	0.05%

-	国泰君安证券股份有限公司-天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金	2,384,187,969.00	95.31%
---	--	------------------	--------

注：持有人为场内持有人。前十名持有人为除天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金之外的前十名持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2020年08月07日)基金份额总额	333,908,470.00
本报告期期初基金份额总额	2,481,408,470.00
本报告期基金总申购份额	252,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	232,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,501,408,470.00

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，聂挺进先生担任公司副总经理，具体信息请参见基金管理人在规定媒介披露的《天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

本报告期内，南翰仪同志任职国泰君安证券资产托管部副总经理(主持工作)。陈忠义同志任国泰君安证券公司副总裁，不再兼任资产托管部总经理职务。具体信息参见国泰君安证券资产托管与基金服务网站公告《关于国泰君安证券股份有限公司资产托管部负责人变更的公告》。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，未发生涉及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，本基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金所聘用的会计师事务所未发生变化。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未发生受稽查或处罚的情况。

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，本基金托管人及其高级管理人员未发生受稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	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	
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东方	1	-	-	-	-	-

证券						
方正证券	5	208,018,547.89	21.95%	92,793.91	28.98%	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	3	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券	8	515,098,988.80	54.36%	127,311.56	39.76%	-
国投证券	3	104,059,256.48	10.98%	46,410.12	14.49%	-
海通证券	3	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	1	795,512.81	0.08%	354.80	0.11%	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	36,763,344.11	3.88%	16,392.84	5.12%	-
中金财富	1	44,399,232.34	4.69%	19,797.97	6.18%	-
中金	1	-	-	-	-	-

公司						
中泰证券	2	37,359,195.65	3.94%	16,664.15	5.20%	-
中信建投证券	2	1,090,831.00	0.12%	486.41	0.15%	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准为：财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强；具有较强的综合服务能力，能及时、全面提供高质量的关于宏观策略、行业、资本市场、个股分析的研究服务及丰富全面的信息咨询服务；具有较强的证券交易服务能力，能够提供安全、便捷、优质的证券交易服务及合理的佣金费率。

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

3、本基金报告期内新租用交易单元：中金公司北交所交易单元。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：国泰君安证券深圳交易单元、国投证券上海交易单元、国投证券深圳交易单元。

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
东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	24,000.00	3.84%	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	555,015.16	88.90%	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-	-	-

江海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	45,302.40	7.26%	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	天弘基金管理有限公司关于指定旗下证券投资基金主流流动性服务商的公告	中国证监会规定媒介	2024-01-03
2	天弘基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	中国证监会规定媒介	2024-01-13
3	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金2023年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2024-01-22
4	天弘基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	中国证监会规定媒介	2024-01-25
5	天弘基金将严格落实《证监会新闻发言人就“两融”融券业务有关情况答记者问》相关要求	中国证监会规定媒介	2024-02-06
6	天弘基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	中国证监会规定媒介	2024-02-22
7	天弘基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公	中国证监会规定媒介	2024-02-26

	告		
8	天弘基金管理有限公司关于天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2024-02-29
9	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2024-03-07
10	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会规定媒介	2024-03-08
11	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金2023年年度报告	中国证监会规定媒介	2024-03-29
12	天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2024-03-30
13	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金2024年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2024-04-22
14	关于天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商终止的公告	中国证监会规定媒介	2024-04-27
15	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2024-05-13
16	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2024-05-28
17	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2024-06-03
18	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金基金产品	中国证监会规定媒介	2024-06-28

	资料概要（更新）		
19	天弘基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	中国证监会规定媒介	2024-06-29

§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	20240101-20240630	2,361,606,069.00	170,403,000.00	147,821,100.00	2,384,187,969.00	95.31%

产品特有风险

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

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

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

（3）持有基金份额占比较高的投资者大额赎回可能引发基金净值大幅波动的风险；

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

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

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

2、份额占比精度处理方式为四舍五入。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

12.3 查阅方式

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

公司网站：www.thfund.com.cn

天弘基金管理有限公司

二〇二四年八月三十日