嘉实中证A500交易型开放式指数证券投资基金
2025年中期报告

2025年6月30日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2025年8月29日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 08 月 27 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 2025 年 01 月 01 日起至 2025 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2

1.1 重要提示 2
1.2 目录 3

§2 基金简介 5

2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6

§3 主要财务指标和基金净值表现 6

3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
3.3 其他指标 7

§4 管理人报告 7

4.1 基金管理人及基金经理情况 7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 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 10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 11

§5 托管人报告 12

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 12
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 12

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 12

6.1 资产负债表 12
6.2 利润表 13
6.3 净资产变动表 14
6.4 报表附注 16

§7 投资组合报告 37

7.1 期末基金资产组合情况 37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 38
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 39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 53

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 53
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 53
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 53
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 53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 54
7.12 投资组合报告附注 54
§8 基金份额持有人信息 55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 55
8.2 期末上市基金前十名持有人 55
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 56
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 56
§9 开放式基金份额变动 56
§10 重大事件揭示 56
10.1 基金份额持有人大会决议 56
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 56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 56
10.4 基金投资策略的改变 56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 57
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 57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 57
10.8 其他重大事件 58
§11 影响投资者决策的其他重要信息 59
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 59
§12 备查文件目录 59
12.1 备查文件目录 59
12.2 存放地点 59
12.3 查阅方式 59

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	嘉实中证 A500ETF
场内简称	A500ETF 嘉实
基金主代码	159351
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 9 月 20 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	17,951,123,357.00 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	2024 年 10 月 15 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况（如流动性原因等）导致无法完全投资于标的指数成份股时，或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时，基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到跟踪标的指数的目的。 具体投资策略包括：股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略等。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其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。 本基金为被动式投资的股票型指数基金，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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		嘉实基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	郭松	冯萌
	联系电话	(010)65215588	021-52629999-213310
	电子邮箱	service@jsfund.cn	fengmeng@cib.com.cn
客户服务电话		400-600-8800	95561
传真		(010)65215588	021-62159217

注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号1806A单元	福建省福州市台江区江滨中大道398号兴业银行大厦
办公地址	北京市朝阳区建国门外大街21号北京国际俱乐部C座写字楼12A层	上海市浦东新区银城路167号4楼
邮政编码	100020	200120
法定代表人	经雷	吕家进

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025年1月1日-2025年6月30日)
本期已实现收益	-144,716,499.20
本期利润	163,487,546.01
加权平均基金份额本期利润	0.0111
本期加权平均净值利润率	1.15%
本期基金份额净值增长率	1.63%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025年6月30日)
期末可供分配利润	-168,345,102.37
期末可供分配基金份额利润	-0.0094
期末基金资产净值	17,782,778,254.63
期末基金份额净值	0.9906
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-0.73%

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

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

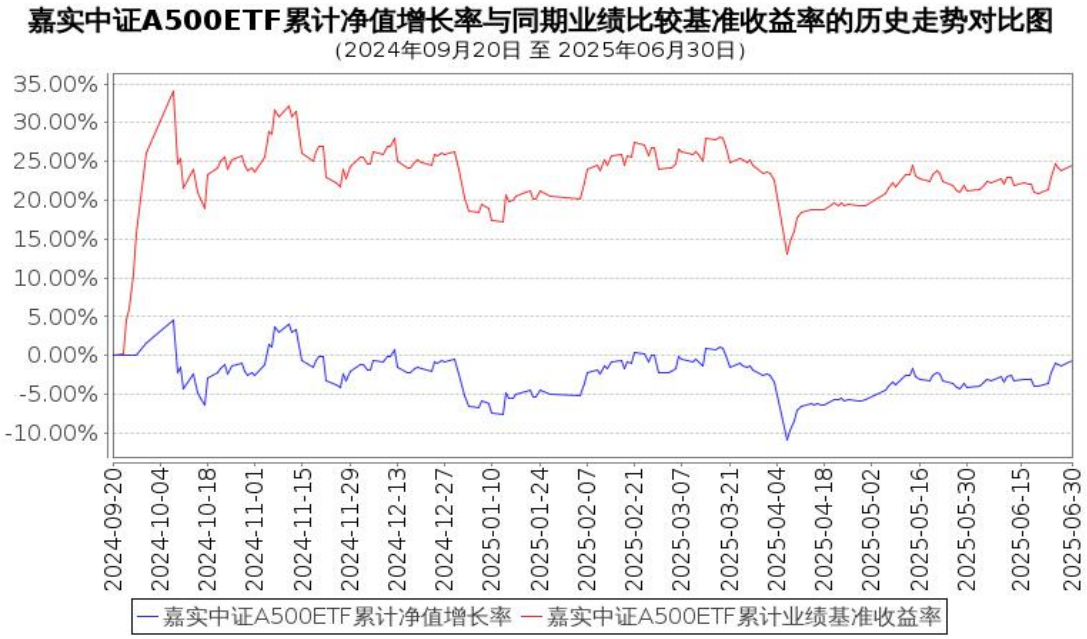
（3）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	3.55%	0.59%	2.82%	0.60%	0.73%	-0.01%
过去三个月	1.88%	1.20%	0.84%	1.20%	1.04%	0.00%
过去六个月	1.63%	1.10%	0.47%	1.10%	1.16%	0.00%
自基金合同生效起至今	-0.73%	1.26%	24.60%	1.60%	-25.33%	-0.34%

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）本基金合同生效日 2024 年 09 月 20 日至报告期末未满 1 年。

（2）按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5 号文批准，于 1999 年 3 月 25 日成立。

公司注册地上海，总部设在北京并设北京、深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII 和特定资产管理业务等资格。

截止 2025 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 366 只公募基金，覆盖主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、资产配置、海外投资、FOF、基础设施基金等不同类别。同时，还管理多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和单一/集合资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘珈吟	本基金、嘉实沪深 300ETF 联接(LOF)、嘉实沪深 300ETF 、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实富时中国 A50ETF 联接、嘉实富时中国 A50ETF 、嘉实央企创新驱动 ETF、嘉实央企创新驱动 ETF 联接、嘉实中证主要消费 ETF 发起联接、嘉实中证全指家用电器指数发起式、嘉实中证国新央企现代能源	2024 年 9 月 20 日	-	16 年	2009 年加入嘉实基金管理有限公司，曾任指数投资部指数研究员。现任指数投资部负责人。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

	ETF、嘉实中证国新央企现代能源 ETF 联接、嘉实中证 A500ETF 联接基金经理				
张超梁	本基金、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400ETF 联接、嘉实中证信息安全主题 ETF、嘉实中证高端装备细分 50ETF、嘉实中证高端装备细分 50ETF 发起联接、嘉实中证 A500ETF 联接、嘉实创业板 50ETF、嘉实创业板 50ETF 联接基金经理	2024 年 9 月 20 日	-	11 年	曾任国金基金管理有限公司量化分析师助理、量化分析师、投资经理、基金经理助理，华夏基金管理有限公司研究发展部产品经理，方正富邦基金管理有限公司指数投资部基金经理。2022 年 3 月加入嘉实基金管理有限公司任 SmartBeta 和指数投资部投资经理。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

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

（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
张超梁	公募基金	9	23,926,438,395.91	2024 年 1 月 25 日

	私募资产管理计划	1	573,392.22	2024 年 7 月 15 日
	其他组合	-	-	-
	合计	10	23,927,011,788.13	-

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的，合计 5 次，其中 2 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，另 3 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪中证 A500 指数，中证 A500 指数从各行业选取市值较大、流动性较好的 500 只证券作为指数样本，以反映各行业最具代表性上市公司证券的整体表现。本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。

回顾上半年，外部扰动不断，但宏观经济复苏进程仍在持续推进。一季度关税预期压制进出口贸易，但政策持续发力推动部分产业景气度修复，战略性新兴产业尤为突出。4、5 月超预期关税的落地造成了较大冲击，货币政策的进一步宽松和社融改善推动内需结构性改善，高新技术产

品出口及高技术制造业增加值大幅提升。总体来看，上半年增量政策效果逐步显现，高新技术产品成为经济发展新动能。

本报告期内，剔除建仓期，本基金日均跟踪偏离为 0.02%，年化跟踪误差为 0.48%，符合基金合同约定的年化跟踪误差不超过 2.00%的限制。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.9906 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.63%，业绩比较基准收益率为 0.47%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，积极的总量政策仍将持续，货币和社融同比增速在低基数的背景下有望保持稳健。随着货币和信贷的宽松推动经济增长、关税等国际贸易冲击逐渐消退，内外需有望相继企稳。

本基金作为一只投资于中证 A500 指数的被动投资管理产品，我们继续秉承指数化被动投资策略，积极应对基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，降低本基金的跟踪误差，给投资者提供一个标准化的中证 A500 指数的投资工具。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照《企业会计准则》及中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于基金资产估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求，履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，研究、指导基金估值业务。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，具备投研、风险管理、基金估值运作、法律合规等方面的专业胜任能力。

本基金管理人使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制，与估值相关的机构包括基金投资市场的证券交易场所以及境内相关机构等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。基金管理人在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	177,996,928.26	94,386,625.54
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	17,753,213,645.95	12,776,624,616.74
其中：股票投资		17,752,929,227.25	12,776,624,616.74
基金投资		-	-
债券投资		284,418.70	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-

债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		17,931,210,574.21	12,871,011,242.28
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2025 年 6 月 30 日**	**上年度末 2024 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		145,420,432.50	33,956,296.22
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,826,660.52	1,520,629.47
应付托管费		608,886.82	506,876.50
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.67	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	576,339.07	90,329.00
负债合计		148,432,319.58	36,074,131.19
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	17,951,123,357.00	13,139,123,357.00
未分配利润	6.4.7.12	-168,345,102.37	-304,186,245.91
净资产合计		17,782,778,254.63	12,834,937,111.09
负债和净资产总计		17,931,210,574.21	12,871,011,242.28

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.9906 元，基金份额总额 17,951,123,357.00 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		177,703,745.85
1.利息收入		51,325.68
其中：存款利息收入	6.4.7.13	51,325.68
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）		-146,274,117.87
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-326,677,770.83
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	446,832.45
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-
股利收益	6.4.7.19	179,956,820.51
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	308,204,045.21
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	15,722,492.83
减：二、营业总支出		14,216,199.84
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	10,599,153.73
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,533,051.26
3. 销售服务费		-
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		0.82
8. 其他费用	6.4.7.23	83,994.03
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		163,487,546.01
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		163,487,546.01
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		163,487,546.01

6.3 净资产变动表

会计主体：嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	13,139,123,357.00	-	-304,186,245.91	12,834,937,111.09
二、本期期初净资产	13,139,123,357.00	-	-304,186,245.91	12,834,937,111.09
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	4,812,000,000.00	-	135,841,143.54	4,947,841,143.54
（一）、综合收益总额	-	-	163,487,546.01	163,487,546.01
（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）	4,812,000,000.00	-	2,066,834.56	4,814,066,834.56
其中：1.基金申购款	14,031,000,000.00	-	-411,221,892.97	13,619,778,107.03
2.基金赎回款	-9,219,000,000.00	-	413,288,727.53	-8,805,711,272.47
（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）	-	-	-29,713,237.03	-29,713,237.03
四、本期期末净资产	17,951,123,357.00	-	-168,345,102.37	17,782,778,254.63

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

经雷	梁凯	李袁
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

嘉实中证 A500 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[2024]1263 号《关于准予嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册，由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实中证 A500 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，存续期限不定。经向中国证监会备案，《嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2024 年 9 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,000,123,357.00 份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融　房地产开发　教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	1,965,575.10
等于：本金	1,965,471.03
加：应计利息	104.07
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	176,031,353.16
等于：本金	176,027,999.49
加：应计利息	3,353.67
减：坏账准备	-
合计	177,996,928.26

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		17,690,891,360.46	-	17,752,929,227.25	62,037,866.79
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	284,400.00	18.70	284,418.70	0.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	284,400.00	18.70	284,418.70	0.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	17,691,175,760.46	18.70	17,753,213,645.95	62,037,866.79

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	83,310.68
其他	493,028.39
合计	576,339.07

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	13,139,123,357.00	13,139,123,357.00
本期申购	14,031,000,000.00	14,031,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-9,219,000,000.00	-9,219,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	17,951,123,357.00	17,951,123,357.00

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	37,171,956.34	-341,358,202.25	-304,186,245.91

本期期初	37,171,956.34	-341,358,202.25	-304,186,245.91
本期利润	-144,716,499.20	308,204,045.21	163,487,546.01
本期基金份额交易产生的变动数	-13,149,971.89	15,216,806.45	2,066,834.56
其中：基金申购款	-74,239,485.27	-336,982,407.70	-411,221,892.97
基金赎回款	61,089,513.38	352,199,214.15	413,288,727.53
本期已分配利润	-29,713,237.03	-	-29,713,237.03
本期末	-150,407,751.78	-17,937,350.59	-168,345,102.37

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
活期存款利息收入	2,749.83
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	48,575.85
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	51,325.68

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-151,671,536.01
股票投资收益——赎回差价收入	-175,006,234.82
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	-326,677,770.83

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出股票成交总额	6,397,666,541.19
减：卖出股票成本总额	6,542,194,124.53
减：交易费用	7,143,952.67
买卖股票差价收入	-151,671,536.01

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日

赎回基金份额对价总额	8,805,711,272.47
减：现金支付赎回款总额	5,053,621,901.47
减：赎回股票成本总额	3,927,095,605.82
减：交易费用	-
赎回差价收入	-175,006,234.82

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	220.20
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	446,612.25
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	446,832.45

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,836,862.35
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,389,900.00
减：应计利息总额	208.27
减：交易费用	141.83
买卖债券差价收入	446,612.25

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	179,956,820.51
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	179,956,820.51

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
1.交易性金融资产	308,204,045.21
股票投资	308,204,045.21
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2.衍生工具	-
权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	308,204,045.21

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	15,722,492.83
合计	15,722,492.83

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
审计费用	23,803.31
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	683.35
合计	83,994.03

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

根据相关法律法规以及本基金收益分配政策，本基金向截至2025年7月14日登记在册的全

体基金份额持有人进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.0640 元。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司(“嘉实基金”)	基金管理人
兴业银行股份有限公司(“兴业银行”)	基金托管人
嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(“嘉实中证 A500ETF 联接”)	本基金的联接基金

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	10,599,153.73
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,037,105.02
应支付基金管理人的净管理费	9,562,048.71

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 0.15%的年费率计提，逐日累计至每

月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

2.根据本基金的基金管理人与各代销机构签订的基金代销协议，客户维护费按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,533,051.26

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费＝前一日基金资产净值×0.05%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
报告期初持有的基金份额	200,013,611.00
报告期间申购/买入总份额	-
报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	200,013,611.00
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	1.11%

注：本基金的基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

申购/买入含红利再投、转换入份额，赎回/卖出含转换出份额。

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 2025年6月30日		上年度末 2024年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
嘉实中证A500ETF联接	3,826,800,000.00	21.32	4,754,000,000.00	36.18
中诚信托	434,846,474.00	2.42	239,779,674.00	1.82

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 2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司_活期	1,965,575.10	2,749.83

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

报告期末(2025年06月30日)，本基金持有12,875,000.00股兴业银行的A股普通股，估值总额为人民币300,502,500.00元，占基金资产净值的比例为1.69%（2024年12月31日：8,220,500.00股，估值总额为人民币157,504,780.00元，占基金资产净值的比例为1.23%)。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2025年1月16日	-	2025年1月16日	0.0100	13,604,117.60	-	13,604,117.60	2024年年度收益分配于2025年实施
2	2025年4月16日	-	2025年4月16日	0.0100	16,109,119.43	-	16,109,119.43	-
合计	-	-	-	0.0200	29,713,237.03	-	29,713,237.03	-

注：根据相关法律法规以及本基金收益分配政策，本基金向截至2025年7月14日登记在册的全

体基金份额持有人进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.0640 元。

6.4.12 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新发未上市	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	6 个月	新股锁定	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
301275	汉朔科技	2025 年 3 月 4 日	6 个月	新股锁定	27.50	56.19	397	10,917.50	22,307.43	-
301479	弘景光电	2025 年 3 月 6 日	6 个月	新股锁定	41.90	77.87	182	5,447.00	14,172.34	-
301590	优优绿能	2025 年 5 月 28 日	6 个月	新股锁定	89.60	139.48	73	6,540.80	10,182.04	-
301636	泽润新能	2025 年 4 月 30 日	6 个月	新股锁定	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301658	首航新能	2025 年 3 月 26 日	6 个月	新股锁定	11.80	22.98	437	5,156.60	10,042.26	-
301665	泰禾股份	2025 年 4 月 2 日	6 个月	新股锁定	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-
301678	新恒	2025 年 6	6 个月	新股锁定	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	-

	汇	月 13 日								
603014	威高血净	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁定	26.50	32.68	205	5,432.50	6,699.40	-
603049	中策橡胶	2025 年 5 月 27 日	6 个月	新股锁定	46.50	42.85	724	33,666.00	31,023.40	-
603257	中国瑞林	2025 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁定	20.52	37.47	78	1,600.56	2,922.66	-
603400	华之杰	2025 年 6 月 12 日	6 个月	新股锁定	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
688411	海博思创	2025 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁定	19.38	83.49	560	10,852.80	46,754.40	-
688545	兴福电子	2025 年 1 月 15 日	6 个月	新股锁定	11.68	26.95	994	11,609.92	26,788.30	-
688757	胜科纳米	2025 年 3 月 18 日	6 个月	新股锁定	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	-
688775	影石创新	2025 年 6 月 4 日	6 个月	新股锁定	47.27	124.16	573	27,085.71	71,143.68	-

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
123257	安克转债	2025 年 6 月 16 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.01	2,844	284,400.00	284,418.70	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，新增股票的受

限期、流通受限类型和期末估值价格与原股票一致。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于股票型基金，其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。本基金为被动式投资的股票型指数基金，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。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及基金投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年化跟踪误差不超过2%。本基金的基金管理人按照法律法规和中国证监会的规定，建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构，建立健全内部控制机制和风险管理制度，坚持审慎经营理念，保护投资者利益和公司合法权益。

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	284,418.70	-
未评级	-	-
合计	284,418.70	-

注：评级取自第三方评级机构。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照相关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短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。

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的

久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	177,996,928.26	-	-	-	177,996,928.26
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	284,418.70	17,752,929,227.25	17,753,213,645.95
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	177,996,928.26	-	284,418.70	17,752,929,227.25	17,931,210,574.21
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	145,420,432.50	145,420,432.50
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,826,660.52	1,826,660.52
应付托管费	-	-	-	608,886.82	608,886.82
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.67	0.67
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	576,339.07	576,339.07
负债总计	-	-	-	148,432,319.58	148,432,319.58
利率敏感度缺口	177,996,928.26	-	284,418.70	17,604,496,907.67	17,782,778,254.63
上年度末 2024 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	94,386,625.54	-	-	-	94,386,625.54

结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	12,776,624,616.74	12,776,624,616.74
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	94,386,625.54	-	-	12,776,624,616.74	12,871,011,242.28
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	33,956,296.22	33,956,296.22
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,520,629.47	1,520,629.47
应付托管费	-	-	-	506,876.50	506,876.50
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	90,329.00	90,329.00
负债总计	-	-	-	36,074,131.19	36,074,131.19
利率敏感度缺口	94,386,625.54	-	-	12,740,550,485.55	12,834,937,111.09

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
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 （2025 年 6 月 30 日）	上年度末 （2024 年 12 月 31 日 ）

	市场利率上升25个基点	-4,062.05	-
	市场利率下降25个基点	4,131.48	-

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
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（2025年6月30日）	上年度末（2024年12月31日）
	所有外币相对人民币升值5%	-	-
	所有外币相对人民币贬值5%	-	-

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024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	17,752,929,227.25	99.83	12,776,624,616.74	99.55
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	17,752,929,227.25	99.83	12,776,624,616.74	99.55

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩基准以外的其他市场变量保持不变		
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 （2025 年 6 月 30 日）	上年度末 （2024 年 12 月 31 日 ）
	业绩比较基准上升 5%	887,254,891.60	352,918,205.10
	业绩比较基准下降 5%	-887,254,891.60	-352,918,205.10

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日

第一层次	17,752,623,516.36	12,758,637,430.74
第二层次	299,804.24	17,987,186.00
第三层次	290,325.35	-
合计	17,753,213,645.95	12,776,624,616.74

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	17,752,929,227.25	99.01
	其中：股票	17,752,929,227.25	99.01
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	284,418.70	0.00
	其中：债券	284,418.70	0.00
	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	177,996,928.26	0.99
8	其他各项资产	-	-
9	合计	17,931,210,574.21	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	96,752,541.20	0.54
B	采矿业	896,802,915.59	5.04
C	制造业	10,311,040,770.51	57.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	547,368,816.00	3.08
E	建筑业	338,007,428.40	1.90
F	批发和零售业	125,733,517.00	0.71
G	交通运输、仓储和邮政业	619,970,346.95	3.49
H	住宿和餐饮业	15,429,408.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,173,179,935.25	6.60
J	金融业	2,873,824,390.72	16.16
K	房地产业	185,613,645.00	1.04
L	租赁和商务服务业	197,115,632.90	1.11
M	科学研究和技术服务业	197,350,083.48	1.11
N	水利、环境和公共设施管理业	38,977,925.00	0.22
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	11,657,988.00	0.07
Q	卫生和社会工作	67,811,577.36	0.38
R	文化、体育和娱乐业	55,977,759.00	0.31
S	综合	-	-
	合计	17,752,614,680.36	99.83

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	288,884.39	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
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	16,826.50	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	305,710.89	0.00

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	488,864	689,063,585.28	3.87
2	300750	宁德时代	2,037,219	513,827,376.18	2.89
3	601318	中国平安	8,328,300	462,054,084.00	2.60
4	600036	招商银行	9,576,300	440,030,985.00	2.47
5	601166	兴业银行	12,875,000	300,502,500.00	1.69
6	600900	长江电力	9,468,300	285,374,562.00	1.60
7	000333	美的集团	3,796,360	274,097,192.00	1.54
8	601899	紫金矿业	12,747,500	248,576,250.00	1.40

9	002594	比亚迪	698,159	231,725,953.69	1.30
10	300059	东方财富	9,775,178	226,099,867.14	1.27
11	600030	中信证券	7,560,009	208,807,448.58	1.17
12	601398	工商银行	27,121,900	205,855,221.00	1.16
13	600276	恒瑞医药	3,460,644	179,607,423.60	1.01
14	000858	五 粮 液	1,508,200	179,324,980.00	1.01
15	601328	交通银行	20,660,865	165,286,920.00	0.93
16	000651	格力电器	3,468,374	155,799,360.08	0.88
17	601288	农业银行	24,695,600	145,210,128.00	0.82
18	600887	伊利股份	4,894,480	136,458,102.40	0.77
19	002475	立讯精密	3,929,741	136,322,715.29	0.77
20	688981	中芯国际	1,544,904	136,214,185.68	0.77
21	600919	江苏银行	11,366,600	135,717,204.00	0.76
22	603259	药明康德	1,932,600	134,412,330.00	0.76
23	601816	京沪高铁	22,728,000	130,686,000.00	0.73
24	600000	浦发银行	9,087,125	126,129,295.00	0.71
25	002371	北方华创	256,700	113,515,307.00	0.64
26	000725	京东方A	28,161,720	112,365,262.80	0.63
27	300760	迈瑞医疗	472,200	106,126,950.00	0.60
28	601088	中国神华	2,549,401	103,352,716.54	0.58
29	688041	海光信息	731,458	103,347,700.82	0.58
30	300308	中际旭创	685,329	99,962,087.94	0.56
31	601601	中国太保	2,641,600	99,086,416.00	0.56
32	300502	新易盛	763,260	96,949,285.20	0.55
33	688256	寒武纪	157,390	94,670,085.00	0.53
34	300124	汇川技术	1,453,100	93,826,667.00	0.53
35	601728	中国电信	12,019,300	93,149,575.00	0.52
36	601668	中国建筑	15,999,920	92,319,538.40	0.52
37	002352	顺丰控股	1,862,200	90,800,872.00	0.51
38	000001	平安银行	7,488,100	90,381,367.00	0.51
39	002714	牧原股份	2,119,120	89,024,231.20	0.50
40	002230	科大讯飞	1,788,800	85,647,744.00	0.48
41	601127	赛力斯	631,100	84,769,352.00	0.48
42	603501	豪威集团	657,970	83,989,870.50	0.47
43	600031	三一重工	4,595,000	82,480,250.00	0.46
44	000063	中兴通讯	2,488,700	80,857,863.00	0.45
45	603019	中科曙光	1,133,800	79,819,520.00	0.45
46	002415	海康威视	2,859,389	79,290,856.97	0.45
47	600309	万华化学	1,450,900	78,725,834.00	0.44
48	600941	中国移动	696,400	78,379,820.00	0.44
49	300274	阳光电源	1,124,140	76,182,967.80	0.43
50	601857	中国石油	8,774,800	75,024,540.00	0.42
51	601919	中远海控	4,875,800	73,332,032.00	0.41

52	688008	澜起科技	893,618	73,276,676.00	0.41
53	600690	海尔智家	2,907,783	72,054,862.74	0.41
54	600660	福耀玻璃	1,238,700	70,618,287.00	0.40
55	601012	隆基绿能	4,693,000	70,488,860.00	0.40
56	600406	国电南瑞	3,104,308	69,567,542.28	0.39
57	601766	中国中车	9,421,700	66,328,768.00	0.37
58	603986	兆易创新	516,400	65,340,092.00	0.37
59	000568	泸州老窖	569,900	64,626,660.00	0.36
60	600050	中国联通	12,091,400	64,568,076.00	0.36
61	000338	潍柴动力	4,187,700	64,406,826.00	0.36
62	600028	中国石化	11,286,460	63,655,634.40	0.36
63	300476	胜宏科技	470,255	63,192,866.90	0.36
64	000100	TCL科技	14,515,475	62,852,006.75	0.35
65	601988	中国银行	11,090,900	62,330,858.00	0.35
66	601006	大秦铁路	9,358,300	61,764,780.00	0.35
67	688012	中微公司	329,891	60,139,129.30	0.34
68	601985	中国核电	6,375,300	59,417,796.00	0.33
69	601225	陕西煤业	3,002,200	57,762,328.00	0.32
70	600104	上汽集团	3,582,600	57,500,730.00	0.32
71	002027	分众传媒	7,818,271	57,073,378.30	0.32
72	600150	中国船舶	1,733,000	56,391,820.00	0.32
73	600418	江淮汽车	1,348,300	54,053,347.00	0.30
74	601628	中国人寿	1,287,400	53,028,006.00	0.30
75	603288	海天味业	1,288,363	50,130,204.33	0.28
76	600760	中航沈飞	846,800	49,639,416.00	0.28
77	000425	徐工机械	6,360,200	49,418,754.00	0.28
78	605499	东鹏饮料	156,939	49,286,692.95	0.28
79	000792	盐湖股份	2,868,550	48,994,834.00	0.28
80	688111	金山办公	174,628	48,904,571.40	0.28
81	000625	长安汽车	3,831,100	48,884,836.00	0.27
82	600111	北方稀土	1,955,000	48,679,500.00	0.27
83	600938	中国海油	1,849,300	48,285,223.00	0.27
84	688271	联影医疗	372,869	47,630,286.06	0.27
85	600905	三峡能源	11,078,700	47,195,262.00	0.27
86	600089	特变电工	3,916,430	46,723,009.90	0.26
87	002625	光启技术	1,167,540	46,678,249.20	0.26
88	601658	邮储银行	8,532,700	46,673,869.00	0.26
89	601888	中国中免	751,400	45,812,858.00	0.26
90	603993	洛阳钼业	5,438,600	45,793,012.00	0.26
91	002050	三花智控	1,733,947	45,741,521.86	0.26
92	600436	片仔癀	227,559	45,514,075.59	0.26
93	300015	爱尔眼科	3,607,100	45,016,608.00	0.25
94	600048	保利发展	5,552,600	44,976,060.00	0.25

95	600019	宝钢股份	6,779,700	44,678,223.00	0.25
96	601390	中国中铁	7,941,800	44,553,498.00	0.25
97	600547	山东黄金	1,394,000	44,510,420.00	0.25
98	002463	沪电股份	1,044,500	44,474,810.00	0.25
99	300033	同花顺	162,200	44,282,222.00	0.25
100	002241	歌尔股份	1,888,600	44,042,152.00	0.25
101	600415	小商品城	2,129,100	44,029,788.00	0.25
102	300014	亿纬锂能	956,019	43,795,230.39	0.25
103	601600	中国铝业	6,133,300	43,178,432.00	0.24
104	601989	中国重工	8,824,900	40,947,536.00	0.23
105	000977	浪潮信息	792,208	40,307,543.04	0.23
106	002384	东山精密	1,058,500	39,979,545.00	0.22
107	600893	航发动力	1,036,200	39,935,148.00	0.22
108	002179	中航光电	988,645	39,901,712.20	0.22
109	600585	海螺水泥	1,856,400	39,856,908.00	0.22
110	600570	恒生电子	1,172,400	39,322,296.00	0.22
111	603799	华友钴业	1,057,700	39,156,054.00	0.22
112	000538	云南白药	687,964	38,381,511.56	0.22
113	600584	长电科技	1,109,900	37,392,531.00	0.21
114	000938	紫光股份	1,554,400	37,290,056.00	0.21
115	000988	华工科技	773,000	36,338,730.00	0.20
116	601727	上海电气	4,896,200	36,182,918.00	0.20
117	002028	思源电气	484,600	35,332,186.00	0.20
118	600438	通威股份	2,082,500	34,881,875.00	0.20
119	300408	三环集团	1,042,000	34,802,800.00	0.20
120	002049	紫光国微	527,600	34,747,736.00	0.20
121	300433	蓝思科技	1,548,500	34,531,550.00	0.19
122	000002	万　　科A	5,259,700	33,767,274.00	0.19
123	600795	国电电力	6,911,600	33,452,144.00	0.19
124	600489	中金黄金	2,253,900	32,974,557.00	0.19
125	601669	中国电建	6,661,900	32,443,453.00	0.18
126	600988	赤峰黄金	1,285,900	31,993,192.00	0.18
127	601689	拓普集团	670,625	31,687,031.25	0.18
128	600010	包钢股份	17,515,600	31,352,924.00	0.18
129	300339	润和软件	615,800	31,301,114.00	0.18
130	002422	科伦药业	858,700	30,844,504.00	0.17
131	600009	上海机场	969,500	30,801,015.00	0.17
132	002456	欧菲光	2,568,950	30,442,057.50	0.17
133	601100	恒立液压	420,100	30,247,200.00	0.17
134	600160	巨化股份	1,049,120	30,088,761.60	0.17
135	002460	赣锋锂业	881,103	29,754,848.31	0.17
136	000768	中航西飞	1,078,588	29,488,595.92	0.17
137	300394	天孚通信	366,768	29,282,757.12	0.16

138	600183	生益科技	946,300	28,530,945.00	0.16
139	601186	中国铁建	3,560,800	28,522,008.00	0.16
140	002252	上海莱士	4,098,800	28,158,756.00	0.16
141	600839	四川长虹	2,862,700	27,825,444.00	0.16
142	601360	三六零	2,716,000	27,703,200.00	0.16
143	000157	中联重科	3,825,300	27,656,919.00	0.16
144	600989	宝丰能源	1,704,500	27,510,630.00	0.15
145	688036	传音控股	343,948	27,412,655.60	0.15
146	600886	国投电力	1,856,400	27,363,336.00	0.15
147	000963	华东医药	676,600	27,307,576.00	0.15
148	002074	国轩高科	831,200	26,980,752.00	0.15
149	600115	中国东航	6,624,200	26,695,526.00	0.15
150	601058	赛轮轮胎	2,029,100	26,621,792.00	0.15
151	300442	润泽科技	534,400	26,468,832.00	0.15
152	000661	长春高新	261,200	25,905,816.00	0.15
153	000408	藏格矿业	607,000	25,900,690.00	0.15
154	000807	云铝股份	1,614,000	25,791,720.00	0.15
155	600066	宇通客车	1,032,500	25,667,950.00	0.14
156	002466	天齐锂业	794,400	25,452,576.00	0.14
157	002001	新 和 成	1,188,400	25,277,268.00	0.14
158	002340	格林美	3,958,900	25,139,015.00	0.14
159	600426	华鲁恒升	1,151,900	24,961,673.00	0.14
160	600196	复星医药	989,700	24,831,573.00	0.14
161	300661	圣邦股份	341,192	24,828,541.84	0.14
162	002195	岩山科技	4,381,448	24,667,552.24	0.14
163	600029	南方航空	4,174,100	24,627,190.00	0.14
164	001979	招商蛇口	2,802,400	24,577,048.00	0.14
165	601800	中国交建	2,759,000	24,527,510.00	0.14
166	688169	石头科技	156,093	24,436,359.15	0.14
167	301236	软通动力	446,408	24,391,733.12	0.14
168	002236	大华股份	1,535,000	24,375,800.00	0.14
169	000975	山金国际	1,286,000	24,356,840.00	0.14
170	600011	华能国际	3,408,300	24,335,262.00	0.14
171	600674	川投能源	1,517,100	24,334,284.00	0.14
172	002156	通富微电	944,700	24,203,214.00	0.14
173	002517	恺英网络	1,250,800	24,152,948.00	0.14
174	688126	沪硅产业	1,273,291	23,836,007.52	0.13
175	002558	巨人网络	1,001,300	23,580,615.00	0.13
176	600487	亨通光电	1,533,700	23,465,610.00	0.13
177	600346	恒力石化	1,639,200	23,374,992.00	0.13
178	300251	光线传媒	1,136,500	23,036,855.00	0.13
179	300207	欣旺达	1,143,657	22,941,759.42	0.13
180	601111	中国国航	2,902,100	22,897,569.00	0.13

181	300418	昆仑万维	677,600	22,787,688.00	0.13
182	600372	中航机载	1,871,200	22,566,672.00	0.13
183	600460	士兰微	908,800	22,556,416.00	0.13
184	600745	闻泰科技	672,400	22,545,572.00	0.13
185	002648	卫星化学	1,299,892	22,527,128.36	0.13
186	601868	中国能建	10,039,500	22,388,085.00	0.13
187	000066	中国长城	1,502,404	22,235,579.20	0.13
188	003816	中国广核	6,061,100	22,062,404.00	0.12
189	688608	恒玄科技	63,363	22,049,056.74	0.12
190	600096	云天化	993,500	21,827,195.00	0.12
191	601117	中国化学	2,840,800	21,788,936.00	0.12
192	002916	深南电路	201,120	21,682,747.20	0.12
193	688213	思特威	212,104	21,681,270.88	0.12
194	300347	泰格医药	404,739	21,580,683.48	0.12
195	600741	华域汽车	1,219,900	21,531,235.00	0.12
196	601319	中国人保	2,471,500	21,526,765.00	0.12
197	002273	水晶光电	1,077,000	21,507,690.00	0.12
198	002465	海格通信	1,542,800	21,506,632.00	0.12
199	601168	西部矿业	1,289,100	21,437,733.00	0.12
200	688777	中控技术	476,911	21,418,073.01	0.12
201	601021	春秋航空	384,503	21,397,591.95	0.12
202	002920	德赛西威	209,302	21,376,013.26	0.12
203	600879	航天电子	2,037,100	21,328,437.00	0.12
204	600588	用友网络	1,592,800	21,295,736.00	0.12
205	600256	广汇能源	3,520,100	21,191,002.00	0.12
206	300782	卓胜微	296,840	21,185,470.80	0.12
207	600176	中国巨石	1,856,800	21,167,520.00	0.12
208	688120	华海清科	124,950	21,079,065.00	0.12
209	300450	先导智能	841,900	20,921,215.00	0.12
210	002601	龙佰集团	1,288,800	20,891,448.00	0.12
211	601633	长城汽车	971,492	20,867,648.16	0.12
212	000831	中国稀土	575,300	20,779,836.00	0.12
213	002555	三七互娱	1,195,900	20,677,111.00	0.12
214	600219	南山铝业	5,391,200	20,648,296.00	0.12
215	000786	北新建材	779,100	20,630,568.00	0.12
216	002294	信立泰	434,728	20,575,676.24	0.12
217	600352	浙江龙盛	2,008,800	20,409,408.00	0.11
218	600885	宏发股份	910,989	20,324,164.59	0.11
219	600482	中国动力	880,579	20,314,957.53	0.11
220	688235	百济神州	86,756	20,269,671.84	0.11
221	300017	网宿科技	1,887,098	20,229,690.56	0.11
222	000933	神火股份	1,215,500	20,225,920.00	0.11
223	600039	四川路桥	2,016,000	19,958,400.00	0.11

224	300896	爱美客	114,120	19,949,317.20	0.11
225	000630	铜陵有色	5,926,400	19,794,176.00	0.11
226	302132	中航成飞	222,100	19,531,474.00	0.11
227	002185	华天科技	1,928,000	19,472,800.00	0.11
228	002493	荣盛石化	2,345,400	19,419,912.00	0.11
229	600085	同仁堂	532,300	19,194,738.00	0.11
230	688002	睿创微纳	275,057	19,176,974.04	0.11
231	002129	TCL中环	2,495,425	19,164,864.00	0.11
232	001965	招商公路	1,586,100	19,033,200.00	0.11
233	688617	惠泰医疗	63,798	18,948,006.00	0.11
234	688396	华润微	400,405	18,883,099.80	0.11
235	002709	天赐材料	1,040,700	18,857,484.00	0.11
236	002595	豪迈科技	316,800	18,760,896.00	0.11
237	601877	正泰电器	825,500	18,714,085.00	0.11
238	002281	光迅科技	379,400	18,712,008.00	0.11
239	600362	江西铜业	798,100	18,699,483.00	0.11
240	300223	北京君正	269,900	18,677,080.00	0.11
241	000423	东阿阿胶	355,200	18,576,960.00	0.10
242	002130	沃尔核材	774,600	18,450,972.00	0.10
243	603392	万泰生物	301,420	18,386,620.00	0.10
244	300474	景嘉微	251,300	18,344,900.00	0.10
245	002131	利欧股份	5,226,800	18,293,800.00	0.10
246	002085	万丰奥威	1,150,205	18,276,757.45	0.10
247	300122	智飞生物	931,600	18,250,044.00	0.10
248	300866	安克创新	160,330	18,213,488.00	0.10
249	688099	晶晨股份	254,022	18,038,102.22	0.10
250	002738	中矿资源	559,300	17,987,088.00	0.10
251	300058	蓝色光标	2,741,160	17,982,009.60	0.10
252	002532	天山铝业	2,163,900	17,982,009.00	0.10
253	300454	深信服	190,870	17,976,136.60	0.10
254	300002	神州泰岳	1,523,116	17,972,768.80	0.10
255	688506	百利天恒	60,474	17,907,560.88	0.10
256	688122	西部超导	342,912	17,790,274.56	0.10
257	600161	天坛生物	925,032	17,751,364.08	0.10
258	603596	伯特利	335,594	17,682,447.86	0.10
259	300832	新产业	311,300	17,656,936.00	0.10
260	002472	双环传动	526,500	17,632,485.00	0.10
261	002180	纳思达	766,200	17,576,628.00	0.10
262	002138	顺络电子	622,400	17,501,888.00	0.10
263	603129	春风动力	80,600	17,449,900.00	0.10
264	002078	太阳纸业	1,294,400	17,422,624.00	0.10
265	002938	鹏鼎控股	539,500	17,280,185.00	0.10
266	002436	兴森科技	1,303,900	17,263,636.00	0.10

267	600233	圆通速递	1,330,700	17,152,723.00	0.10
268	002410	广联达	1,274,300	17,088,363.00	0.10
269	002128	电投能源	860,220	17,015,151.60	0.10
270	300346	南大光电	536,384	16,971,189.76	0.10
271	000301	东方盛虹	2,034,300	16,945,719.00	0.10
272	600143	金发科技	1,637,300	16,880,563.00	0.09
273	603606	东方电缆	326,406	16,878,454.26	0.09
274	300395	菲利华	330,300	16,878,330.00	0.09
275	600862	中航高科	645,900	16,845,072.00	0.09
276	600188	兖矿能源	1,379,100	16,783,647.00	0.09
277	300759	康龙化成	683,000	16,760,820.00	0.09
278	300496	中科创达	292,700	16,748,294.00	0.09
279	000034	神州数码	444,200	16,719,688.00	0.09
280	300024	机器人	973,200	16,719,576.00	0.09
281	002223	鱼跃医疗	468,800	16,689,280.00	0.09
282	300136	信维通信	744,700	16,681,280.00	0.09
283	300054	鼎龙股份	581,300	16,671,684.00	0.09
284	002065	东华软件	1,735,800	16,663,680.00	0.09
285	002353	杰瑞股份	476,100	16,663,500.00	0.09
286	601618	中国中冶	5,525,100	16,464,798.00	0.09
287	002202	金风科技	1,605,100	16,452,275.00	0.09
288	000999	华润三九	518,818	16,228,627.04	0.09
289	688072	拓荆科技	105,464	16,210,871.44	0.09
290	688047	龙芯中科	120,948	16,133,253.72	0.09
291	601615	明阳智能	1,401,500	16,103,235.00	0.09
292	688223	晶科能源	3,095,733	16,066,854.27	0.09
293	002624	完美世界	1,053,800	15,986,146.00	0.09
294	300383	光环新网	1,114,600	15,938,780.00	0.09
295	002008	大族激光	649,900	15,838,063.00	0.09
296	688578	艾力斯	169,659	15,785,073.36	0.09
297	002271	东方雨虹	1,469,000	15,762,370.00	0.09
298	600845	宝信软件	667,100	15,756,902.00	0.09
299	603087	甘李药业	287,600	15,754,728.00	0.09
300	002405	四维图新	1,832,000	15,645,280.00	0.09
301	300604	长川科技	347,996	15,628,500.36	0.09
302	601872	招商轮船	2,496,300	15,626,838.00	0.09
303	600515	海南机场	4,414,000	15,625,560.00	0.09
304	603659	璞泰来	821,035	15,419,037.30	0.09
305	000733	振华科技	307,700	15,400,385.00	0.09
306	600895	张江高科	599,100	15,396,870.00	0.09
307	002459	晶澳科技	1,541,838	15,387,543.24	0.09
308	600549	厦门钨业	733,900	15,353,188.00	0.09
309	000426	兴业银锡	967,100	15,280,180.00	0.09

310	300459	汤姆猫	2,720,100	15,232,560.00	0.09
311	605117	德业股份	288,478	15,191,251.48	0.09
312	300012	华测检测	1,298,100	15,174,789.00	0.09
313	688266	泽璟制药	139,721	15,021,404.71	0.08
314	002155	湖南黄金	840,033	14,994,589.05	0.08
315	300627	华测导航	427,773	14,972,055.00	0.08
316	603605	珀莱雅	179,300	14,844,247.00	0.08
317	688599	天合光能	1,017,199	14,779,901.47	0.08
318	605589	圣泉集团	526,200	14,602,050.00	0.08
319	300253	卫宁健康	1,365,200	14,471,120.00	0.08
320	300037	新宙邦	409,920	14,429,184.00	0.08
321	601216	君正集团	2,606,700	14,388,984.00	0.08
322	300699	光威复材	453,940	14,376,279.80	0.08
323	600332	白云山	545,300	14,374,108.00	0.08
324	600392	盛和资源	1,088,600	14,336,862.00	0.08
325	000617	中油资本	1,948,600	14,224,780.00	0.08
326	002444	巨星科技	555,700	14,175,907.00	0.08
327	300003	乐普医疗	1,023,131	14,098,745.18	0.08
328	300073	当升科技	320,800	14,073,496.00	0.08
329	000932	华菱钢铁	3,195,400	14,059,760.00	0.08
330	600153	建发股份	1,342,700	13,923,799.00	0.08
331	000878	云南铜业	1,087,400	13,831,728.00	0.08
332	300316	晶盛机电	509,000	13,819,350.00	0.08
333	603979	金诚信	297,500	13,815,900.00	0.08
334	002389	航天彩虹	538,600	13,788,160.00	0.08
335	601233	桐昆股份	1,300,600	13,786,360.00	0.08
336	300628	亿联网络	396,300	13,775,388.00	0.08
337	688180	君实生物	404,525	13,745,759.50	0.08
338	300001	特锐德	572,500	13,722,825.00	0.08
339	300142	沃森生物	1,235,200	13,587,200.00	0.08
340	600803	新奥股份	715,800	13,528,620.00	0.08
341	002414	高德红外	1,318,400	13,513,600.00	0.08
342	601799	星宇股份	107,742	13,467,750.00	0.08
343	000519	中兵红箭	614,000	13,440,460.00	0.08
344	603260	合盛硅业	283,100	13,418,940.00	0.08
345	002821	凯莱英	150,740	13,302,805.00	0.07
346	002812	恩捷股份	453,900	13,294,731.00	0.07
347	600699	均胜电子	759,200	13,240,448.00	0.07
348	300568	星源材质	1,043,100	13,226,508.00	0.07
349	002007	华兰生物	841,600	13,187,872.00	0.07
350	600118	中国卫星	461,500	13,185,055.00	0.07
351	600177	雅戈尔	1,790,000	13,067,000.00	0.07
352	600521	华海药业	697,900	13,001,877.00	0.07

353	002152	广电运通	965,153	12,971,656.32	0.07
354	600398	海澜之家	1,857,600	12,928,896.00	0.07
355	601238	广汽集团	1,715,900	12,852,091.00	0.07
356	600316	洪都航空	340,100	12,821,770.00	0.07
357	300315	掌趣科技	2,109,600	12,805,272.00	0.07
358	600704	物产中大	2,410,100	12,701,227.00	0.07
359	000738	航发控制	610,300	12,663,725.00	0.07
360	300413	芒果超媒	579,300	12,640,326.00	0.07
361	600038	中直股份	324,800	12,605,488.00	0.07
362	600497	驰宏锌锗	2,365,900	12,515,611.00	0.07
363	002044	美年健康	2,416,500	12,420,810.00	0.07
364	002318	久立特材	530,900	12,417,751.00	0.07
365	600018	上港集团	2,169,100	12,385,561.00	0.07
366	000009	中国宝安	1,390,200	12,344,976.00	0.07
367	600765	中航重机	728,400	12,295,392.00	0.07
368	600141	兴发集团	597,600	12,268,728.00	0.07
369	601567	三星医疗	547,200	12,268,224.00	0.07
370	300919	中伟股份	368,594	12,119,370.72	0.07
371	000400	许继电气	552,700	12,032,279.00	0.07
372	601677	明泰铝业	968,700	12,031,254.00	0.07
373	000623	吉林敖东	696,100	11,798,895.00	0.07
374	002409	雅克科技	215,400	11,780,226.00	0.07
375	600637	东方明珠	1,566,700	11,703,249.00	0.07
376	002607	中公教育	3,809,800	11,657,988.00	0.07
377	000960	锡业股份	759,900	11,626,470.00	0.07
378	600498	烽火通信	551,500	11,598,045.00	0.07
379	603939	益丰药房	472,400	11,559,628.00	0.07
380	601607	上海医药	646,400	11,557,632.00	0.06
381	002245	蔚蓝锂芯	898,500	11,527,755.00	0.06
382	300088	长信科技	1,923,000	11,461,080.00	0.06
383	688188	柏楚电子	86,984	11,452,313.44	0.06
384	600529	山东药玻	515,600	11,415,384.00	0.06
385	002841	视源股份	329,800	11,411,080.00	0.06
386	300724	捷佳伟创	209,800	11,392,140.00	0.06
387	300757	罗博特科	75,900	11,382,723.00	0.06
388	300182	捷成股份	2,051,300	11,302,663.00	0.06
389	002407	多氟多	926,900	11,298,911.00	0.06
390	002739	万达电影	984,700	11,255,121.00	0.06
391	301358	湖南裕能	357,600	11,153,544.00	0.06
392	600026	中远海能	1,079,300	11,149,169.00	0.06
393	000039	中集集团	1,417,100	11,138,406.00	0.06
394	600563	法拉电子	101,800	11,105,362.00	0.06
395	300558	贝达药业	190,400	11,033,680.00	0.06

396	601018	宁波港	3,011,900	11,023,554.00	0.06
397	300068	南都电源	692,200	11,019,824.00	0.06
398	000887	中鼎股份	610,807	10,744,095.13	0.06
399	300285	国瓷材料	616,600	10,698,010.00	0.06
400	600486	扬农化工	184,000	10,672,000.00	0.06
401	002025	航天电器	206,700	10,626,447.00	0.06
402	600820	隧道股份	1,706,400	10,409,040.00	0.06
403	603806	福斯特	802,500	10,400,400.00	0.06
404	300144	宋城演艺	1,214,400	10,383,120.00	0.06
405	600763	通策医疗	251,312	10,374,159.36	0.06
406	300763	锦浪科技	180,700	10,370,373.00	0.06
407	688303	大全能源	485,272	10,345,999.04	0.06
408	600008	首创环保	3,412,300	10,305,146.00	0.06
409	688009	中国通号	1,995,780	10,258,309.20	0.06
410	300296	利亚德	1,678,900	10,241,290.00	0.06
411	002497	雅化集团	898,100	10,238,340.00	0.06
412	002064	华峰化学	1,540,000	10,179,400.00	0.06
413	600516	方大炭素	2,185,900	10,142,576.00	0.06
414	002312	川发龙蟒	882,400	10,129,952.00	0.06
415	603486	科沃斯	173,561	10,106,457.03	0.06
416	603568	伟明环保	529,400	10,100,952.00	0.06
417	600998	九州通	1,946,800	10,006,552.00	0.06
418	600166	福田汽车	3,673,300	9,954,643.00	0.06
419	603816	顾家家居	387,500	9,889,000.00	0.06
420	600170	上海建工	4,126,700	9,862,813.00	0.06
421	605358	立昂微	420,200	9,790,660.00	0.06
422	601179	中国西电	1,591,700	9,773,038.00	0.05
423	600208	衢州发展	3,299,300	9,765,928.00	0.05
424	600312	平高电气	629,600	9,689,544.00	0.05
425	002432	九安医疗	263,898	9,613,804.14	0.05
426	000683	博源化工	1,999,500	9,577,605.00	0.05
427	002176	江特电机	1,314,500	9,543,270.00	0.05
428	601155	新城控股	697,100	9,536,328.00	0.05
429	002244	滨江集团	968,100	9,438,975.00	0.05
430	300676	华大基因	189,300	9,421,461.00	0.05
431	600323	瀚蓝环境	384,100	9,352,835.00	0.05
432	601000	唐山港	2,295,000	9,317,700.00	0.05
433	000818	航锦科技	413,200	9,297,000.00	0.05
434	000830	鲁西化工	893,900	9,207,170.00	0.05
435	603885	吉祥航空	678,500	9,139,395.00	0.05
436	000629	钒钛股份	3,568,900	9,136,384.00	0.05
437	002603	以岭药业	644,900	9,093,090.00	0.05
438	000708	中信特钢	772,756	9,087,610.56	0.05

439	600535	天士力	578,700	9,056,655.00	0.05
440	002439	启明星辰	563,000	9,002,370.00	0.05
441	300567	精测电子	147,747	8,954,945.67	0.05
442	603613	国联股份	375,830	8,903,412.70	0.05
443	600499	科达制造	898,100	8,801,380.00	0.05
444	600511	国药股份	299,700	8,739,252.00	0.05
445	603000	人民网	432,100	8,732,741.00	0.05
446	601880	辽港股份	5,806,400	8,709,600.00	0.05
447	300390	天华新能	453,400	8,646,338.00	0.05
448	603899	晨光股份	293,401	8,505,694.99	0.05
449	002145	中核钛白	2,049,200	8,504,180.00	0.05
450	600859	王府井	608,900	8,457,621.00	0.05
451	000563	陕国投A	2,366,900	8,449,833.00	0.05
452	688005	容百科技	377,253	8,420,286.96	0.05
453	600655	豫园股份	1,514,900	8,407,695.00	0.05
454	600004	白云机场	922,800	8,397,480.00	0.05
455	603077	和邦生物	4,783,000	8,370,250.00	0.05
456	000547	航天发展	993,500	8,345,400.00	0.05
457	601966	玲珑轮胎	567,400	8,323,758.00	0.05
458	600325	华发股份	1,707,000	8,313,090.00	0.05
459	600131	国网信通	468,600	8,294,220.00	0.05
460	002756	永兴材料	259,200	8,229,600.00	0.05
461	300529	健帆生物	376,300	8,116,791.00	0.05
462	600754	锦江酒店	359,900	8,076,156.00	0.05
463	300601	康泰生物	520,620	7,908,217.80	0.04
464	603833	欧派家居	137,800	7,778,810.00	0.04
465	300438	鹏辉能源	280,500	7,744,605.00	0.04
466	000998	隆平高科	784,600	7,728,310.00	0.04
467	300070	碧水源	1,682,300	7,570,350.00	0.04
468	002544	普天科技	322,500	7,562,625.00	0.04
469	600667	太极实业	1,143,000	7,520,940.00	0.04
470	002120	韵达股份	1,122,100	7,518,070.00	0.04
471	600867	通化东宝	916,500	7,515,300.00	0.04
472	601866	中远海发	3,042,300	7,514,481.00	0.04
473	600258	首旅酒店	520,400	7,353,252.00	0.04
474	300751	迈为股份	105,400	7,331,624.00	0.04
475	000032	深桑达A	358,300	7,248,409.00	0.04
476	300457	赢合科技	308,500	7,095,500.00	0.04
477	002508	老板电器	370,600	7,045,106.00	0.04
478	000069	华侨城A	3,088,600	6,949,350.00	0.04
479	002831	裕同科技	295,900	6,929,978.00	0.04
480	000967	盈峰环境	985,300	6,847,835.00	0.04
481	300118	东方日升	702,900	6,733,782.00	0.04

482	300573	兴齐眼药	129,540	6,708,876.60	0.04
483	002292	奥飞娱乐	683,900	6,647,508.00	0.04
484	600129	太极集团	309,200	6,589,052.00	0.04
485	002572	索菲亚	450,800	6,315,708.00	0.04
486	601636	旗滨集团	1,244,500	6,234,945.00	0.04
487	002266	浙富控股	2,009,100	6,188,028.00	0.03
488	688063	派能科技	129,508	5,838,220.64	0.03
489	603650	彤程新材	180,700	5,809,505.00	0.03
490	600864	哈投股份	971,800	5,801,646.00	0.03
491	000035	中国天楹	1,344,000	5,765,760.00	0.03
492	600315	上海家化	269,100	5,669,937.00	0.03
493	300769	德方纳米	169,100	5,583,682.00	0.03
494	688390	固德威	128,044	5,563,511.80	0.03
495	002091	江苏国泰	750,800	5,458,316.00	0.03
496	002372	伟星新材	494,900	5,127,164.00	0.03
497	001914	招商积余	334,600	4,139,002.00	0.02
498	600007	中国国贸	152,000	3,128,160.00	0.02
499	600335	国机汽车	466,800	3,010,860.00	0.02
500	301381	赛维时代	90,600	1,807,470.00	0.01

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	688775	影石创新	573	71,143.68	0.00
2	688411	海博思创	560	46,754.40	0.00
3	603049	中策橡胶	724	31,023.40	0.00
4	688545	兴福电子	994	26,788.30	0.00
5	301275	汉朔科技	397	22,307.43	0.00
6	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
7	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
8	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
9	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.00
10	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
11	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
12	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
13	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
14	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
15	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
16	603400	华之杰	57	2,497.17	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	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)

	码			
1	600519	贵州茅台	739,483,962.63	5.76
2	601318	中国平安	349,803,886.50	2.73
3	600036	招商银行	330,840,227.07	2.58
4	601166	兴业银行	233,980,015.60	1.82
5	600900	长江电力	220,552,012.01	1.72
6	601899	紫金矿业	178,357,461.82	1.39
7	600030	中信证券	166,147,999.81	1.29
8	601398	工商银行	151,271,111.00	1.18
9	688041	海光信息	142,063,060.38	1.11
10	600276	恒瑞医药	139,552,592.44	1.09
11	688981	中芯国际	132,134,984.87	1.03
12	601328	交通银行	130,903,244.20	1.02
13	600887	伊利股份	109,769,229.88	0.86
14	601288	农业银行	105,491,365.00	0.82
15	601816	京沪高铁	103,649,763.00	0.81
16	600919	江苏银行	93,517,832.34	0.73
17	603259	药明康德	92,435,949.30	0.72
18	600000	浦发银行	81,959,793.27	0.64
19	601088	中国神华	76,202,080.71	0.59
20	688008	澜起科技	75,865,637.69	0.59

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	600519	贵州茅台	541,917,398.64	4.22
2	601318	中国平安	225,421,108.27	1.76
3	600036	招商银行	213,396,867.20	1.66
4	600900	长江电力	145,643,569.99	1.13
5	601166	兴业银行	126,539,858.83	0.99
6	601899	紫金矿业	113,206,528.22	0.88
7	688041	海光信息	112,778,384.87	0.88
8	600030	中信证券	108,159,360.90	0.84
9	601398	工商银行	98,403,940.00	0.77
10	600276	恒瑞医药	93,953,911.84	0.73
11	688981	中芯国际	93,556,923.62	0.73
12	601988	中国银行	75,143,994.00	0.59
13	600887	伊利股份	73,179,623.37	0.57
14	601328	交通银行	72,546,420.00	0.57
15	601816	京沪高铁	68,937,624.00	0.54
16	601288	农业银行	68,495,717.00	0.53
17	002371	北方华创	66,801,526.93	0.52
18	600919	江苏银行	59,606,236.00	0.46

19	603259	药明康德	57,047,336.10	0.44
20	688008	澜起科技	56,216,384.65	0.44

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	9,381,743,871.72
卖出股票收入（成交）总额	6,397,666,541.19

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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）	284,418.70	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	284,418.70	0.00

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	123257	安克转债	2,844	284,418.70	0.00

注：报告期末，本基金仅持有上述1只债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，其中，兴业银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责或/及处罚的情况。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资管理制度的相关规定。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

无。

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688775	影石创新	71,143.68	0.00	新股锁定
2	688411	海博思创	46,754.40	0.00	新股锁定
3	603049	中策橡胶	31,023.40	0.00	新股锁定
4	688545	兴福电子	26,788.30	0.00	新股锁定
5	301275	汉朔科技	22,307.43	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

无。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
20,273	885,469.51	17,225,942,180.00	95.96	725,181,177.00	4.04

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例（%）
嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	3,826,800,000.00	21.32

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	中国人寿保险股份有限公司	1,352,047,800.00	7.53
2	中国国际金融股份有限公司	760,645,439.00	4.24
3	北京诚通金控投资有限公司	687,606,499.00	3.83
4	华泰证券股份有限公司	666,704,321.00	3.71
5	国泰海通证券股份有限公司	584,902,637.00	3.26
6	方正证券股份有限公司	505,724,821.00	2.82
7	中诚信托有限责任公司	434,846,474.00	2.42
8	中国银河证券股份有限公司	428,054,018.00	2.38
9	大家人寿保险股份有限公司－万能产品	403,946,500.00	2.25
10	光大证券股份有限公司	334,248,518.00	1.86
11	嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	3,826,800,000.00	21.32

注：上述基金持有人份额均为场内基金份额。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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	21,001.00	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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2024 年 9 月 20 日）基金份额总额	2,000,123,357.00
本报告期期初基金份额总额	13,139,123,357.00
本报告期基金总申购份额	14,031,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	9,219,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	17,951,123,357.00

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

（1）基金管理人的重大人事变动情况

2025 年 5 月 22 日本基金管理人发布公告，刘伟先生任公司首席信息官、杨竞霜先生离任公司副总经理、首席信息官。

（2）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所，会计师事务所为容诚会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
国泰海通证券股份有限公司	8	15,778,021,763.04	100.00	2,933,465.83	100.00	-

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

2.交易单元的选择标准和程序

（1）经营行为规范；

（2）财务状况良好；

（3）合规风控能力较强；

（4）交易等服务能力较强。

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

3.国泰君安证券股份有限公司于 2025 年 3 月 14 日完成吸收合并海通证券股份有限公司，并自 2025 年 4 月 3 日起更名为国泰海通证券股份有限公司。上表中列示的国泰海通证券股份有限公司相关数据包含了被合并后的海通证券股份有限公司相关数据。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
国泰海通证券股份有限公司	2,836,862.35	100.00	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第一次收益分配公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 1 月 13 日
2	关于嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 1 月 24 日
3	嘉实基金管理有限公司关于指定旗下部分证券投资基金主流动性服务商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 2 月 5 日
4	关于嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 3 月 3 日
5	关于嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 3 月 28 日
6	关于嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 4 月 7 日
7	嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第一次收益分配公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 4 月 11 日
8	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 5 月 22 日
9	嘉实基金管理有限公司关于调整证券投资基金主流动性服务商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 5 月 23 日
10	嘉实基金管理有限公司关于指定旗下部分证券投资基金主流动性服务商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 5 月 28 日
11	嘉实基金管理有限公司关于旗下部分深交所 ETF 变更场内简称的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 6 月 16 日

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
联接基金	1	2025-01-01 至 2025-06-30	4,754,000,000.00	247,500,000.00	1,174,700,000.00	3,826,800,000.00	21.32
产品特有风险							
报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。 未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式或者与其他基金合并或者终止基金合同等情形。							

注：申购份额包括申购、转换转入、红利再投或份额拆分等导致增加的份额，赎回份额包括赎回、转换转出或份额合并等导致减少的份额。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

（1）中国证监会准予嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复文件。

（2）《嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

（3）《嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

（4）《嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；

（5）基金管理人业务资格批件、营业执照；

（6）报告期内嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金公告的各项原稿。

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

（2）网站查询：基金管理人网址：http://www.jsfund.cn

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-600-8800，

或发 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2025 年 8 月 29 日