

嘉实中证 500 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
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	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	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
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	54
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	54
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	54
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	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54
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	55
§ 8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末上市基金前十名持有人	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
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	57
§ 9 开放式基金份额变动	57
§ 10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
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	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
10.8 其他重大事件	62
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	63
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	63
§ 12 备查文件目录	63
12.1 备查文件目录	63
12.2 存放地点	63
12.3 查阅方式	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	嘉实中证 500ETF
场内简称	中证 500ETF
基金主代码	159922
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 2 月 6 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,771,676,765.00 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	2013 年 3 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。
投资策略	本基金采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况（如流动性原因）导致无法获得足够数量的股票时，或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时，基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到跟踪标的指数的目的。 本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，筛选具有比较优势的存托凭证作为投资标的。本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如期权、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。 本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。
业绩比较基准	中证 500 指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	嘉实基金管理有限公司		中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	郭松	王小飞
	联系电话	(010) 65215588	021-60637103
	电子邮箱	service@jsfund.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-600-8800	021-60637228
传真		(010) 65215588	021-60635778
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 1806A 单元	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市朝阳区建国门外大街 21 号 北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		100020	100033
法定代表人		经雷	张金良

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	423,560,083.13
本期利润	561,057,451.37
加权平均基金份额本期利润	0.1157
本期加权平均净值利润率	5.03%
本期基金份额净值增长率	4.36%
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	5,289,553,372.25
期末可供分配基金份额利润	1.1085
期末基金资产净值	11,381,901,819.53
期末基金份额净值	2.3853
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	97.16%

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	5.04%	0.77%	4.31%	0.79%	0.73%	-0.02%
过去三个月	2.04%	1.50%	0.98%	1.50%	1.06%	0.00%
过去六个月	4.36%	1.35%	3.31%	1.36%	1.05%	-0.01%
过去一年	21.36%	1.72%	19.68%	1.72%	1.68%	0.00%
过去三年	-3.76%	1.35%	-8.35%	1.35%	4.59%	0.00%
自基金合同生效起至今	97.16%	1.56%	68.02%	1.57%	29.14%	-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：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 3 个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5 号文批准，于 1999 年 3 月 25 日成立。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		
何如	本基金、嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF)、嘉实沪深 300ETF、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实国证通信 ETF 发起联接、嘉实中证 A50ETF 联接基金经理	2016 年 1 月 5 日	-	19 年	曾任职于 IA 克莱灵顿投资管理公司 (IA-Clarington Investments Inc)、富兰克林坦普顿投资管理公司 (Franklin Templeton Investments Corp.)。2007 年 6 月加入嘉实基金管理有限公司，先后任职于产品管理部、指数投资部，现任指数基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格。加拿大国籍。
李直	本基金、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实深证基本面 120ETF、嘉实深证基本面	2021 年 9 月 24 日	-	10 年	2014 年 7 月加入嘉实基金管理有限公司，从事指数基金投资研究工作，现任基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

120ETF 联接、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实基本面 50ETF、嘉实中证大农业 ETF、嘉实中证科创创业 50ETF、嘉实中证新能源汽车指数、嘉实中证科创创业 50ETF 发起联接、嘉实中证光伏产业指数发起式、嘉实中证 2000ETF、嘉实中证大农业 ETF 发起联接、嘉实中证 A100ETF、嘉实中证 A100ETF 发起联接基金经理				
--	--	--	--	--

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

（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 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
李直	公募基金	15	18,361,443,852.58	2017 年 12 月 26 日

	私募资产管理计划	1	10,267,722.49	2025 年 5 月 12 日
	其他组合	-	-	-
	合计	16	18,371,711,575.07	-

注：1. “任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间；
2. 报告期内，李直管理的 1 只公募基金已于 2025 年 5 月 17 日离任。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实中证 500 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

本基金跟踪中证小盘 500 指数，中证 500 指数由全部 A 股中剔除沪深 300 指数成份股及总市值排名前 300 名的股票后，总市值排名靠前的 500 只股票组成，综合反映中国 A 股市场中一批中小市值公司的股票价格表现。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。海外方面，美国经济的表现极大地影响了降息进程和市场对未来利率水平的预期。1、2 月虽然也有关税不确定性的影响，但美国经济数据总体表现较为积极，美联储对通胀表示关注，3 月并未继续降息。进入二季度，通胀仍未明显下降，同时劳动力市场较为坚挺，5 月平均周薪创历史新高，6 月非农就业超预期，美联储降息预期不断延后。

本报告期内，本基金日均跟踪偏离为 0.01%，年化跟踪误差为 0.39%，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 2.3853 元；本报告期基金份额净值增长率为 4.36%，业绩比较基准收益率为 3.31%。

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小盘 500 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小盘 500 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，本基金未实施利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。具体参见本报告“6.4.11 利润分配情况”。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明
无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：嘉实中证 500 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	149,060,687.24	101,593,254.15
结算备付金		49,792,543.12	47,735,622.95
存出保证金		26,574,668.24	19,870,431.84
交易性金融资产	6.4.7.2	11,159,845,015.93	11,776,161,374.66
其中：股票投资		11,159,720,907.77	11,776,161,374.66
基金投资		-	-
债券投资		124,108.16	-
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		119,686,891.61	84,133,218.36
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		11,504,959,806.14	12,029,493,901.96
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		120,946,627.87	88,009,719.32
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,342,069.36	1,567,851.95
应付托管费		447,356.45	522,617.33
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.34	928,832.07
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	321,932.59	1,624,544.82
负债合计		123,057,986.61	92,653,565.49
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	6,092,348,447.28	6,668,173,106.86
未分配利润	6.4.7.12	5,289,553,372.25	5,268,667,229.61
净资产合计		11,381,901,819.53	11,936,840,336.47
负债和净资产总计		11,504,959,806.14	12,029,493,901.96

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.3853 元，基金份额总额 4,771,676,765.00 份。

6.2 利润表

会计主体： 嘉实中证 500 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	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		573,019,609.66	-690,173,044.86
1. 利息收入		512,360.51	1,809,817.43
其中：存款利息收入	6.4.7.13	444,748.14	481,667.86
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		67,612.37	-
其他利息收入		-	1,328,149.57
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		427,848,007.92	-145,067,527.67
其中：股票投资收益	6.4.7.14	327,365,677.87	-309,051,525.56
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	739,267.03	584,574.46
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	-1,737,686.70	-2,733,786.18
股利收益	6.4.7.19	101,480,749.72	166,133,209.61
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	137,497,368.24	-563,379,604.38
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	7,161,872.99	16,464,269.76
减：二、营业总支出		11,962,158.29	12,336,136.57
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	8,309,982.95	7,962,843.01
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,769,994.33	2,654,281.01
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		10,620.21	4,783.38
8. 其他费用	6.4.7.23	871,560.80	1,714,229.17
三、利润总额（亏损总 额以“-”号填列）		561,057,451.37	-702,509,181.43

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		561,057,451.37	-702,509,181.43
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		561,057,451.37	-702,509,181.43

6.3 净资产变动表

会计主体：嘉实中证 500 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	6,668,173,106.86	-	5,268,667,229.61	11,936,840,336.47
二、本期期初净资产	6,668,173,106.86	-	5,268,667,229.61	11,936,840,336.47
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-575,824,659.58	-	20,886,142.64	-554,938,516.94
（一）、综合收益总额	-	-	561,057,451.37	561,057,451.37
（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）	-575,824,659.58	-	-540,171,308.73	-1,115,995,968.31
其中：1. 基金申购款	3,447,287,320.09	-	2,729,110,858.27	6,176,398,178.36
2. 基金赎回款	-4,023,111,979.67	-	-3,269,282,167.00	-7,292,394,146.67
（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	6,092,348,447.	-	5,289,553,372.	11,381,901,819.

	28		25	53
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	3,661,369,390. 11	—	2,809,744,780. 67	6,471,114,170.7 8
二、本期期初净资产	3,661,369,390. 11	—	2,809,744,780. 67	6,471,114,170.7 8
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	3,889,050,127. 13	—	1,905,581,552. 30	5,794,631,679.4 3
(一)、综合收益总额	—	—	-702,509,181.4 3	-702,509,181.43
(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)	3,889,050,127. 13	—	2,608,090,733. 73	6,497,140,860.8 6
其中：1. 基金申购款	8,475,218,237. 45	—	5,834,301,200. 08	14,309,519,437. 53
2. 基金赎回款	-4,586,168,110 .32	—	-3,226,210,466 .35	-7,812,378,576. 67
(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	7,550,419,517. 24	—	4,715,326,332. 97	12,265,745,850. 21

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

经雷
基金管理人负责人

梁凯
主管会计工作负责人

李袁
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

嘉实中证 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[2012]1588 号《关于核准嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》核准,由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实中证 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。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定。经向中国证监会备案,《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2013 年 2 月 6 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 3,108,729,402.00 份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

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

根据财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局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》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2021]33 号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2024]8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、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》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税; 2018 年 1 月 1 日起, 公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务, 以基金管理人为增值税纳税人, 暂适用简易计税方法, 按照 3% 的征收率缴纳增值税;

(2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不缴纳企业所得税;

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入, 由上市公司代扣代缴个人所得税; 从公开发行和转让市场取得的上市公司股票, 持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的, 暂减按 50% 计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 股息红利所得暂免征收个人所得税。其中, 对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股, 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) 对于基金从事 A 股买卖, 出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税, 对受让方不再缴纳印花税; 对于基金通过深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票, 按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税; 自 2023 年 8 月 28 日起, 出让方减按 0.05% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税;

(5) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%、2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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	149,060,687.24
等于：本金	149,046,400.16
加：应计利息	14,287.08
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	149,060,687.24

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		10,696,515,186.16	-	11,159,720,907.77	463,205,721.61
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	124,100.00	8.16	124,108.16	0.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	124,100.00	8.16	124,108.16	0.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		10,696,639,286.16	8.16	11,159,845,015.93	463,205,721.61

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 2025 年 6 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	206,380,280.00	-	-	-
其中：股指期货投资	206,380,280.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	206,380,280.00	-	-	-

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
IC2507	IC2507	182.00	213,573,360.00	7,193,080.00
合计				7,193,080.00
减：可抵销期货暂收款				7,193,080.00
净额				0.00

注：衍生金融资产/负债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股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产/负债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。

6.4.7.3.3 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	222,753.64
其中：交易所市场	222,753.64
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	99,178.95
合计	321,932.59

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	5,222,676,765.00	6,668,173,106.86
本期申购	2,700,000,000.00	3,447,287,320.09
本期赎回（以“-”号填列）	-3,151,000,000.00	-4,023,111,979.67
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	4,771,676,765.00	6,092,348,447.28

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	8,542,742,093.71	-3,274,074,864.10	5,268,667,229.61
本期期初	8,542,742,093.71	-3,274,074,864.10	5,268,667,229.61
本期利润	423,560,083.13	137,497,368.24	561,057,451.37
本期基金份额交易产生的变动数	-739,706,084.82	199,534,776.09	-540,171,308.73
其中：基金申购款	4,512,125,690.08	-1,783,014,831.81	2,729,110,858.27
基金赎回款	-5,251,831,774.90	1,982,549,607.90	-3,269,282,167.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,226,596,092.02	-2,937,042,719.77	5,289,553,372.25

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	245,201.50
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	196,634.05
其他	2,912.59
合计	444,748.14

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	147,662,693.06

股票投资收益——赎回差价收入	179,702,984.81
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	327,365,677.87

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	5,746,634,590.57
减：卖出股票成本总额	5,594,987,311.37
减：交易费用	3,984,586.14
买卖股票差价收入	147,662,693.06

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	7,292,394,146.67
减：现金支付赎回款总额	3,777,244,946.67
减：赎回股票成本总额	3,335,446,215.19
减：交易费用	—
赎回差价收入	179,702,984.81

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	431.69
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	738,835.34
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	739,267.03

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	5,263,082.46
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,523,600.00
减：应计利息总额	436.62
减：交易费用	210.50
买卖债券差价收入	738,835.34

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

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-1,737,686.70

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	101,480,749.72
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	101,480,749.72

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	121,725,602.09
股票投资	121,725,602.09
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	15,771,766.15
权证投资	-
期货投资	15,771,766.15
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	137,497,368.24

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	7,161,872.99

合计	7,161,872.99
----	--------------

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	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	471.03
指数使用费	767,987.27
存托服务费	3,923.55
合计	871,560.80

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司（“嘉实基金”）	基金管理人
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人
嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“嘉实中证 500ETF 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	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	8,309,982.95	7,962,843.01
其中：应支付销售机构的客户维护费	176,906.71	124,103.22
应支付基金管理人的净管理费	8,133,076.24	7,838,739.79

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	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,769,994.33	2,654,281.01

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

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 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 500ETF联接	705,236,248.00	14.78	754,671,803.00	14.45

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		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司_活期	149,060,687.24	245,201.50	120,948,828.83	194,123.88

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本期(2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日), 本基金未实施利润分配。

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	-
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	-
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	新恒汇	2025 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁定	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	-
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	-

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	1,241	124,100.00	124,108.16	-

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
400174	中天3	2023 年 8 月 30 日	重大事项停牌	0.40	-	-	3,046,725	4,150,777.45	1,218,690.00	-

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

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

本基金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	124,108.16	-
未评级	-	-
合计	124,108.16	-

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	149,060,687.24	-	-	-	149,060,687.24
结算备付金	49,792,543.12	-	-	-	49,792,543.12

存出保证金	945,865.04	-	-	25,628,803.20	26,574,668.24
交易性金融资产	-	-	124,108.16	11,159,720,907.77	11,159,845,015.93
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	119,686,891.61	119,686,891.61
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	199,799,095.40	-	124,108.16	11,305,036,602.58	11,504,959,806.14
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	-	-	-	120,946,627.87	120,946,627.87
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,342,069.36	1,342,069.36
应付托管费	-	-	-	447,356.45	447,356.45
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.34	0.34
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	321,932.59	321,932.59
负债总计	-	-	-	123,057,986.61	123,057,986.61
利率敏感度缺口	199,799,095.40	-	124,108.16	11,181,978,615.97	11,381,901,819.53
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	101,593,254.15	-	-	-	101,593,254.15
结算备付金	47,735,622.95	-	-	-	47,735,622.95
存出保证金	2,026,974.24	-	-	17,843,457.60	19,870,431.84
交易性金融资产	-	-	-	11,776,161,374.66	11,776,161,374.66
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	84,133,218.36	84,133,218.36
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	151,355,851.34	-	-	11,878,138,050.62	12,029,493,901.96
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	-	-	-	88,009,719.32	88,009,719.32
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,567,851.95	1,567,851.95
应付托管费	-	-	-	522,617.33	522,617.33
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	928,832.07	928,832.07
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,624,544.82	1,624,544.82
负债总计	-	-	-	92,653,565.49	92,653,565.49
利率敏感度缺口	151,355,851.34	-	-	11,785,484,485.13	11,936,840,336.47

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	-1,772.51	-
	市场利率下降 25 个基点	1,802.80	-

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	11,159,720,907.77	98.05	11,776,161,374.66	98.65
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	11, 159, 720, 907. 77	98. 05	11, 776, 161, 374. 66	98. 65

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%	568, 231, 751. 00	594, 791, 666. 97
	业绩比较基准下降 5%	-568, 231, 751. 00	-594, 791, 666. 97

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	11, 158, 219, 676. 76	11, 774, 942, 684. 66
第二层次	139, 493. 70	-
第三层次	1, 485, 845. 47	1, 218, 690. 00
合计	11, 159, 845, 015. 93	11, 776, 161, 374. 66

6. 4. 14. 2. 2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末,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

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	11,159,720,907.77	97.00
	其中:股票	11,159,720,907.77	97.00
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	124,108.16	0.00
	其中:债券	124,108.16	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	198,853,230.36	1.73
8	其他各项资产	146,261,559.85	1.27
9	合计	11,504,959,806.14	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	27,814,422.00	0.24

B	采矿业	399,143,510.28	3.51
C	制造业	7,066,413,609.52	62.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	359,758,591.45	3.16
E	建筑业	98,111,165.54	0.86
F	批发和零售业	244,786,146.63	2.15
G	交通运输、仓储和邮政业	185,482,035.95	1.63
H	住宿和餐饮业	29,978,095.11	0.26
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,035,543,363.60	9.10
J	金融业	1,097,313,378.22	9.64
K	房地产业	137,913,192.51	1.21
L	租赁和商务服务业	95,935,292.94	0.84
M	科学研究和技术服务业	75,661,740.91	0.66
N	水利、环境和公共设施管理业	46,789,003.56	0.41
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	22,896,144.00	0.20
Q	卫生和社会工作	51,325,435.36	0.45
R	文化、体育和娱乐业	156,821,936.96	1.38
S	综合	26,532,612.22	0.23
	合计	11,158,219,676.76	98.03

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	268,637.17	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	1, 218, 690. 00	0. 01
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服 务业	13, 903. 84	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	1, 501, 231. 01	0. 01

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	300476	胜宏科技	915, 600	123, 038, 328. 00	1. 08
2	000988	华工科技	1, 526, 251	71, 749, 059. 51	0. 63
3	600988	赤峰黄金	2, 525, 400	62, 831, 952. 00	0. 55
4	300339	润和软件	1, 205, 700	61, 285, 731. 00	0. 54
5	002966	苏州银行	6, 782, 442	59, 549, 840. 76	0. 52
6	600839	四川长虹	5, 600, 400	54, 435, 888. 00	0. 48
7	601162	天风证券	10, 766, 400	53, 078, 352. 00	0. 47
8	601555	东吴证券	6, 027, 570	52, 741, 237. 50	0. 46
9	689009	九号公司	869, 558	51, 451, 746. 86	0. 45
10	688521	芯原股份	527, 380	50, 892, 170. 00	0. 45
11	002517	恺英网络	2, 587, 100	49, 956, 901. 00	0. 44
12	002340	格林美	7, 772, 300	49, 354, 105. 00	0. 43
13	002195	岩山科技	8, 618, 478	48, 522, 031. 14	0. 43
14	002558	巨人网络	2, 055, 900	48, 416, 445. 00	0. 43
15	603893	瑞芯微	315, 992	47, 986, 545. 12	0. 42
16	002261	拓维信息	1, 525, 285	47, 207, 570. 75	0. 41
17	002156	通富微电	1, 840, 790	47, 161, 039. 80	0. 41
18	600487	亨通光电	2, 994, 740	45, 819, 522. 00	0. 40
19	600157	永泰能源	33, 694, 400	45, 150, 496. 00	0. 40
20	002797	第一创业	6, 371, 173	45, 107, 904. 84	0. 40

21	300251	光线传媒	2, 223, 200	45, 064, 264. 00	0. 40
22	300207	欣旺达	2, 238, 300	44, 900, 298. 00	0. 39
23	688608	恒玄科技	128, 800	44, 819, 824. 00	0. 39
24	300803	指南针	545, 255	43, 980, 268. 30	0. 39
25	000066	中国长城	2, 936, 700	43, 463, 160. 00	0. 38
26	688777	中控技术	959, 417	43, 087, 417. 47	0. 38
27	688213	思特威	421, 148	43, 049, 748. 56	0. 38
28	688120	华海清科	253, 989	42, 847, 944. 30	0. 38
29	600096	云天化	1, 936, 000	42, 533, 920. 00	0. 37
30	600536	中国软件	901, 925	42, 183, 032. 25	0. 37
31	601168	西部矿业	2, 531, 842	42, 104, 532. 46	0. 37
32	002273	水晶光电	2, 106, 490	42, 066, 605. 30	0. 37
33	002465	海格通信	3, 013, 300	42, 005, 402. 00	0. 37
34	600879	航天电子	4, 000, 584	41, 886, 114. 48	0. 37
35	300450	先导智能	1, 680, 400	41, 757, 940. 00	0. 37
36	688235	百济神州	176, 352	41, 202, 881. 28	0. 36
37	000831	中国稀土	1, 128, 700	40, 768, 644. 00	0. 36
38	601099	太平洋	10, 337, 700	40, 627, 161. 00	0. 36
39	600352	浙江龙盛	3, 949, 300	40, 124, 888. 00	0. 35
40	002294	信立泰	844, 303	39, 960, 860. 99	0. 35
41	300017	网宿科技	3, 708, 700	39, 757, 264. 00	0. 35
42	000933	神火股份	2, 388, 400	39, 742, 976. 00	0. 35
43	600885	宏发股份	1, 769, 898	39, 486, 424. 38	0. 35
44	002185	华天科技	3, 889, 362	39, 282, 556. 20	0. 35
45	601108	财通证券	4, 927, 400	38, 975, 734. 00	0. 34
46	688617	惠泰医疗	129, 684	38, 516, 148. 00	0. 34
47	688002	睿创微纳	549, 115	38, 284, 297. 80	0. 34
48	601128	常熟银行	5, 028, 316	37, 058, 688. 92	0. 33
49	002130	沃尔核材	1, 529, 900	36, 442, 218. 00	0. 32
50	601577	长沙银行	3, 658, 400	36, 364, 496. 00	0. 32
51	600079	人福医药	1, 731, 200	36, 320, 576. 00	0. 32
52	002281	光迅科技	731, 973	36, 100, 908. 36	0. 32
53	300454	深信服	382, 900	36, 061, 522. 00	0. 32
54	002595	豪迈科技	608, 126	36, 013, 221. 72	0. 32
55	688099	晶晨股份	506, 356	35, 956, 339. 56	0. 32
56	000423	东阿阿胶	685, 999	35, 877, 747. 70	0. 32
57	000997	新 大 陆	1, 107, 376	35, 856, 834. 88	0. 32
58	002085	万丰奥威	2, 253, 100	35, 801, 759. 00	0. 31
59	688469	芯联集成	7, 504, 628	35, 797, 075. 56	0. 31
60	688122	西部超导	687, 044	35, 643, 842. 72	0. 31
61	300223	北京君正	512, 814	35, 486, 728. 80	0. 31
62	603129	春风动力	163, 800	35, 462, 700. 00	0. 31
63	002738	中矿资源	1, 095, 966	35, 246, 266. 56	0. 31

64	300058	蓝色光标	5,367,244	35,209,120.64	0.31
65	002532	天山铝业	4,233,069	35,176,803.39	0.31
66	300002	神州泰岳	2,978,221	35,143,007.80	0.31
67	000783	长江证券	5,030,675	34,862,577.75	0.31
68	300458	全志科技	875,430	34,745,816.70	0.31
69	300474	景嘉微	475,623	34,720,479.00	0.31
70	600109	国金证券	3,943,400	34,583,618.00	0.30
71	002472	双环传动	1,029,516	34,478,490.84	0.30
72	002138	顺络电子	1,220,814	34,329,289.68	0.30
73	002078	太阳纸业	2,545,040	34,256,238.40	0.30
74	603596	伯特利	645,780	34,026,148.20	0.30
75	002436	兴森科技	2,564,833	33,958,388.92	0.30
76	601933	永辉超市	6,879,900	33,711,510.00	0.30
77	002410	广联达	2,507,100	33,620,211.00	0.30
78	002851	麦格米特	664,300	33,308,002.00	0.29
79	300346	南大光电	1,049,380	33,202,383.20	0.29
80	300765	新诺威	640,944	33,130,395.36	0.29
81	600862	中航高科	1,266,100	33,019,888.00	0.29
82	600143	金发科技	3,198,000	32,971,380.00	0.29
83	688072	拓荆科技	214,378	32,952,042.38	0.29
84	300136	信维通信	1,468,063	32,884,611.20	0.29
85	601198	东兴证券	2,942,800	32,812,220.00	0.29
86	600580	卧龙电驱	1,655,983	32,738,783.91	0.29
87	300054	鼎龙股份	1,140,600	32,712,408.00	0.29
88	688525	佰维存储	484,905	32,682,597.00	0.29
89	002065	东华软件	3,404,300	32,681,280.00	0.29
90	002850	科达利	288,446	32,643,433.82	0.29
91	300024	机器人	1,899,833	32,639,130.94	0.29
92	002353	杰瑞股份	931,536	32,603,760.00	0.29
93	300395	菲利华	635,500	32,474,050.00	0.29
94	002223	鱼跃医疗	911,926	32,464,565.60	0.29
95	603606	东方电缆	627,551	32,450,662.21	0.29
96	000034	神州数码	862,100	32,449,444.00	0.29
97	600298	安琪酵母	921,361	32,404,266.37	0.28
98	600873	梅花生物	3,030,875	32,400,053.75	0.28
99	002202	金风科技	3,139,100	32,175,775.00	0.28
100	600363	联创光电	551,200	32,151,496.00	0.28
101	002673	西部证券	4,065,393	32,035,296.84	0.28
102	300496	中科创达	559,100	31,991,702.00	0.28
103	601615	明阳智能	2,755,300	31,658,397.00	0.28
104	000728	国元证券	3,973,250	31,348,942.50	0.28
105	002624	完美世界	2,061,509	31,273,091.53	0.27
106	300857	协创数据	363,300	31,265,598.00	0.27

107	300383	光环新网	2, 179, 173	31, 162, 173. 90	0. 27
108	688578	艾力斯	334, 870	31, 156, 304. 80	0. 27
109	002008	大族激光	1, 275, 200	31, 076, 624. 00	0. 27
110	000021	深科技	1, 654, 392	31, 003, 306. 08	0. 27
111	300115	长盈精密	1, 439, 980	30, 815, 572. 00	0. 27
112	603659	璞泰来	1, 622, 900	30, 478, 062. 00	0. 27
113	600549	厦门钨业	1, 445, 080	30, 231, 073. 60	0. 27
114	300604	长川科技	671, 530	30, 158, 412. 30	0. 26
115	600895	张江高科	1, 171, 862	30, 116, 853. 40	0. 26
116	603087	甘李药业	547, 844	30, 010, 894. 32	0. 26
117	300012	华测检测	2, 554, 449	29, 861, 508. 81	0. 26
118	603160	汇顶科技	419, 900	29, 825, 497. 00	0. 26
119	000426	兴业银锡	1, 885, 102	29, 784, 611. 60	0. 26
120	603605	珀莱雅	359, 406	29, 755, 222. 74	0. 26
121	002155	湖南黄金	1, 656, 572	29, 569, 810. 20	0. 26
122	000733	振华科技	589, 585	29, 508, 729. 25	0. 26
123	600171	上海贝岭	859, 200	29, 427, 600. 00	0. 26
124	688220	翱捷科技	374, 692	29, 338, 383. 60	0. 26
125	300627	华测导航	828, 640	29, 002, 400. 00	0. 25
126	605589	圣泉集团	1, 027, 900	28, 524, 225. 00	0. 25
127	601216	君正集团	5, 118, 300	28, 253, 016. 00	0. 25
128	688361	中科飞测	333, 337	28, 063, 642. 03	0. 25
129	600392	盛和资源	2, 124, 270	27, 976, 635. 90	0. 25
130	601665	齐鲁银行	4, 422, 000	27, 947, 040. 00	0. 25
131	300699	光威复材	881, 894	27, 929, 582. 98	0. 25
132	000750	国海证券	6, 776, 891	27, 920, 790. 92	0. 25
133	300037	新宙邦	792, 266	27, 887, 763. 20	0. 25
134	002444	巨星科技	1, 088, 584	27, 769, 777. 84	0. 24
135	601997	贵阳银行	4, 438, 260	27, 694, 742. 40	0. 24
136	000932	华菱钢铁	6, 288, 634	27, 669, 989. 60	0. 24
137	000519	中兵红箭	1, 264, 029	27, 669, 594. 81	0. 24
138	000729	燕京啤酒	2, 135, 035	27, 606, 002. 55	0. 24
139	688180	君实生物	812, 287	27, 601, 512. 26	0. 24
140	300003	乐普医疗	1, 997, 840	27, 530, 235. 20	0. 24
141	600153	建发股份	2, 636, 500	27, 340, 505. 00	0. 24
142	600060	海信视像	1, 185, 077	27, 280, 472. 54	0. 24
143	601717	郑煤机	1, 634, 571	27, 166, 570. 02	0. 24
144	601990	南京证券	3, 355, 245	27, 110, 379. 60	0. 24
145	601233	桐昆股份	2, 555, 200	27, 085, 120. 00	0. 24
146	601696	中银证券	2, 529, 800	27, 043, 562. 00	0. 24
147	300073	当升科技	616, 172	27, 031, 465. 64	0. 24
148	000878	云南铜业	2, 124, 741	27, 026, 705. 52	0. 24
149	300001	特锐德	1, 122, 757	26, 912, 485. 29	0. 24

150	300142	沃森生物	2,426,500	26,691,500.00	0.23
151	688052	纳芯微	152,923	26,683,534.27	0.23
152	002821	凯莱英	301,213	26,582,047.25	0.23
153	600673	东阳光	2,281,394	26,532,612.22	0.23
154	002414	高德红外	2,588,330	26,530,382.50	0.23
155	603979	金诚信	568,731	26,411,867.64	0.23
156	600369	西南证券	6,046,100	26,300,535.00	0.23
157	002837	英维克	880,770	26,167,676.70	0.23
158	600699	均胜电子	1,496,440	26,097,913.60	0.23
159	002007	华兰生物	1,660,600	26,021,602.00	0.23
160	688027	国盾量子	94,596	26,014,845.96	0.23
161	300373	扬杰科技	494,700	25,674,930.00	0.23
162	600177	雅戈尔	3,508,400	25,611,320.00	0.23
163	600118	中国卫星	896,188	25,604,091.16	0.22
164	688065	凯赛生物	542,781	25,564,985.10	0.22
165	600521	华海药业	1,371,710	25,554,957.30	0.22
166	600398	海澜之家	3,640,700	25,339,272.00	0.22
167	002152	广电运通	1,883,185	25,310,006.40	0.22
168	000893	亚钾国际	839,730	25,309,462.20	0.22
169	600435	北方导航	1,604,210	25,009,633.90	0.22
170	600704	物产中大	4,725,400	24,902,858.00	0.22
171	603345	安井食品	309,600	24,898,032.00	0.22
172	300748	金力永磁	1,042,570	24,854,868.80	0.22
173	600909	华安证券	4,257,570	24,821,633.10	0.22
174	000738	航发控制	1,194,500	24,785,875.00	0.22
175	600316	洪都航空	654,572	24,677,364.40	0.22
176	688249	晶合集成	1,214,966	24,627,360.82	0.22
177	000623	吉林敖东	1,451,498	24,602,891.10	0.22
178	600497	驰宏锌锗	4,632,200	24,504,338.00	0.22
179	002044	美年健康	4,749,700	24,413,458.00	0.21
180	002958	青农商行	6,742,383	24,340,002.63	0.21
181	603179	新泉股份	517,900	24,325,763.00	0.21
182	000009	中国宝安	2,737,250	24,306,780.00	0.21
183	002318	久立特材	1,038,516	24,290,889.24	0.21
184	600765	中航重机	1,433,910	24,204,400.80	0.21
185	600038	中直股份	623,409	24,194,503.29	0.21
186	600141	兴发集团	1,168,641	23,992,199.73	0.21
187	688385	复旦微电	483,943	23,843,871.61	0.21
188	603228	景旺电子	568,280	23,776,835.20	0.21
189	002409	雅克科技	432,651	23,661,683.19	0.21
190	600562	国睿科技	749,300	23,595,457.00	0.21
191	000400	许继电气	1,083,133	23,579,805.41	0.21
192	000528	柳 工	2,451,100	23,555,071.00	0.21

193	002683	广东宏大	694,018	23,554,970.92	0.21
194	600155	华创云信	3,374,600	23,487,216.00	0.21
195	001696	宗申动力	1,043,121	23,418,066.45	0.21
196	300919	中伟股份	708,140	23,283,643.20	0.20
197	688188	柏楚电子	176,813	23,279,199.58	0.20
198	300757	罗博特科	154,300	23,140,371.00	0.20
199	000960	锡业股份	1,498,593	22,928,472.90	0.20
200	002607	中公教育	7,482,400	22,896,144.00	0.20
201	300724	捷佳伟创	421,359	22,879,793.70	0.20
202	600637	东方明珠	3,056,708	22,833,608.76	0.20
203	600498	烽火通信	1,079,350	22,698,730.50	0.20
204	600884	杉杉股份	2,388,545	22,595,635.70	0.20
205	600563	法拉电子	206,966	22,577,920.94	0.20
206	300623	捷捷微电	755,200	22,504,960.00	0.20
207	603939	益丰药房	919,075	22,489,765.25	0.20
208	600529	山东药玻	1,007,185	22,299,075.90	0.20
209	300558	贝达药业	381,900	22,131,105.00	0.19
210	688568	中科星图	610,426	21,981,440.26	0.19
211	002841	视源股份	635,100	21,974,460.00	0.19
212	002739	万达电影	1,922,132	21,969,968.76	0.19
213	000039	中集集团	2,793,506	21,956,957.16	0.19
214	000415	渤海租赁	6,565,500	21,863,115.00	0.19
215	301358	湖南裕能	691,500	21,567,885.00	0.19
216	002653	海思科	509,990	21,531,777.80	0.19
217	600486	扬农化工	368,948	21,398,984.00	0.19
218	002926	华西证券	2,389,165	21,359,135.10	0.19
219	002025	航天电器	415,081	21,339,314.21	0.19
220	600901	江苏金租	3,511,300	21,278,478.00	0.19
221	002385	大北农	5,217,854	21,080,130.16	0.19
222	688017	绿的谐波	168,492	21,042,965.88	0.18
223	000887	中鼎股份	1,195,700	21,032,363.00	0.18
224	300285	国瓷材料	1,207,548	20,950,957.80	0.18
225	300763	锦浪科技	362,200	20,786,658.00	0.18
226	688582	芯动联科	307,100	20,637,120.00	0.18
227	002939	长城证券	2,448,600	20,519,268.00	0.18
228	300144	宋城演艺	2,386,989	20,408,755.95	0.18
229	300679	电连技术	449,600	20,402,848.00	0.18
230	600820	隧道股份	3,338,420	20,364,362.00	0.18
231	002568	百润股份	794,155	20,338,309.55	0.18
232	600863	内蒙华电	4,947,000	20,332,170.00	0.18
233	603486	科沃斯	347,700	20,246,571.00	0.18
234	000723	美锦能源	4,674,549	20,194,051.68	0.18
235	600008	首创环保	6,680,830	20,176,106.60	0.18

236	600132	重庆啤酒	365,900	20,161,090.00	0.18
237	688114	华大智造	309,209	20,046,019.47	0.18
238	002064	华峰化学	3,012,600	19,913,286.00	0.17
239	600390	五矿资本	3,412,300	19,893,709.00	0.17
240	002080	中材科技	1,018,952	19,869,564.00	0.17
241	000513	丽珠集团	550,785	19,850,291.40	0.17
242	600516	方大炭素	4,274,600	19,834,144.00	0.17
243	603568	伟明环保	1,035,167	19,750,986.36	0.17
244	002312	川发龙蟒	1,717,500	19,716,900.00	0.17
245	600998	九州通	3,824,454	19,657,693.56	0.17
246	688538	和辉光电	8,390,435	19,633,617.90	0.17
247	000703	恒逸石化	3,336,773	19,620,225.24	0.17
248	600763	通策医疗	474,901	19,603,913.28	0.17
249	600166	福田汽车	7,206,300	19,529,073.00	0.17
250	600170	上海建工	8,087,070	19,328,097.30	0.17
251	300487	蓝晓科技	384,000	19,315,200.00	0.17
252	002262	恩华药业	924,530	19,211,733.40	0.17
253	600208	衢州发展	6,451,000	19,094,960.00	0.17
254	601179	中国西电	3,107,600	19,080,664.00	0.17
255	002500	山西证券	3,266,314	19,075,273.76	0.17
256	688183	生益电子	372,494	19,071,692.80	0.17
257	603816	顾家家居	745,760	19,031,795.20	0.17
258	603589	口子窖	546,874	19,031,215.20	0.17
259	600312	平高电气	1,232,800	18,972,792.00	0.17
260	605358	立昂微	813,140	18,946,162.00	0.17
261	000683	博源化工	3,950,000	18,920,500.00	0.17
262	300676	华大基因	379,700	18,897,669.00	0.17
263	002203	海亮股份	1,817,706	18,758,725.92	0.16
264	600021	上海电力	2,133,600	18,754,344.00	0.16
265	601155	新城控股	1,370,900	18,753,912.00	0.16
266	600985	淮北矿业	1,636,300	18,555,642.00	0.16
267	600126	杭钢股份	2,050,640	18,455,760.00	0.16
268	002244	滨江集团	1,887,670	18,404,782.50	0.16
269	002432	九安医疗	503,903	18,357,186.29	0.16
270	600380	健康元	1,662,423	18,336,525.69	0.16
271	600583	海油工程	3,353,476	18,309,978.96	0.16
272	000403	派林生物	1,009,710	18,306,042.30	0.16
273	000591	太阳能	4,158,484	18,255,744.76	0.16
274	601000	唐山港	4,491,466	18,235,351.96	0.16
275	600348	华阳股份	2,734,700	18,213,102.00	0.16
276	688728	格科微	1,180,820	18,184,628.00	0.16
277	000060	中金岭南	3,970,272	18,183,845.76	0.16
278	603338	浙江鼎力	383,000	18,154,200.00	0.16

279	000629	钒钛股份	7,048,382	18,043,857.92	0.16
280	688278	特宝生物	249,410	17,984,955.10	0.16
281	000921	海信家电	699,626	17,980,388.20	0.16
282	600872	中炬高新	945,239	17,959,541.00	0.16
283	603885	吉祥航空	1,333,200	17,958,204.00	0.16
284	000830	鲁西化工	1,736,683	17,887,834.90	0.16
285	300567	精测电子	295,081	17,884,859.41	0.16
286	601991	大唐发电	5,640,000	17,878,800.00	0.16
287	002603	以岭药业	1,265,300	17,840,730.00	0.16
288	603379	三美股份	369,276	17,769,561.12	0.16
289	600535	天士力	1,135,000	17,762,750.00	0.16
290	002984	森麒麟	942,280	17,667,750.00	0.16
291	002439	启明星辰	1,104,107	17,654,670.93	0.16
292	600816	建元信托	5,970,600	17,613,270.00	0.15
293	002056	横店东磁	1,231,607	17,427,239.05	0.15
294	300146	汤臣倍健	1,549,194	17,412,940.56	0.15
295	600095	湘财股份	1,732,900	17,380,987.00	0.15
296	600970	中材国际	2,003,277	17,188,116.66	0.15
297	002423	中粮资本	1,397,613	17,092,806.99	0.15
298	000062	深圳华强	636,300	17,091,018.00	0.15
299	600499	科达制造	1,743,691	17,088,171.80	0.15
300	601880	辽港股份	11,373,749	17,060,623.50	0.15
301	603927	中科软	881,591	17,049,969.94	0.15
302	601016	节能风电	5,888,185	17,016,854.65	0.15
303	600685	中船防务	624,600	16,982,874.00	0.15
304	000958	电投产融	2,475,500	16,932,420.00	0.15
305	603000	人民网	837,300	16,921,833.00	0.15
306	301308	江波龙	192,819	16,869,734.31	0.15
307	000636	风华高科	1,226,377	16,850,419.98	0.15
308	300390	天华新能	881,314	16,806,657.98	0.15
309	601611	中国核建	1,827,700	16,796,563.00	0.15
310	600511	国药股份	573,309	16,717,690.44	0.15
311	601666	平煤股份	2,251,200	16,681,392.00	0.15
312	603298	杭叉集团	792,960	16,612,512.00	0.15
313	000563	陕国投 A	4,653,079	16,611,492.03	0.15
314	300212	易华录	762,371	16,589,192.96	0.15
315	600859	王府井	1,190,800	16,540,212.00	0.15
316	603737	三棵树	447,347	16,484,736.95	0.14
317	000155	川能动力	1,677,772	16,475,721.04	0.14
318	601456	国联民生	1,590,763	16,464,397.05	0.14
319	600655	豫园股份	2,956,600	16,409,130.00	0.14
320	603077	和邦生物	9,375,248	16,406,684.00	0.14
321	688520	神州细胞	273,036	16,341,204.60	0.14

322	600004	白云机场	1,793,800	16,323,580.00	0.14
323	000598	兴蓉环境	2,262,202	16,310,476.42	0.14
324	601966	玲珑轮胎	1,111,650	16,307,905.50	0.14
325	300677	英科医疗	688,339	16,299,867.52	0.14
326	600325	华发股份	3,339,777	16,264,713.99	0.14
327	600483	福能股份	1,684,420	16,237,808.80	0.14
328	603899	晨光股份	559,680	16,225,123.20	0.14
329	002773	康弘药业	559,800	16,217,406.00	0.14
330	603156	养元饮品	762,671	16,138,118.36	0.14
331	688301	奕瑞科技	184,132	16,131,804.52	0.14
332	600131	国网信通	910,600	16,117,620.00	0.14
333	601958	金钼股份	1,468,700	16,067,578.00	0.14
334	688297	中无人机	300,383	16,040,452.20	0.14
335	600378	昊华科技	588,200	15,922,574.00	0.14
336	000050	深天马 A	1,863,484	15,876,883.68	0.14
337	600663	陆家嘴	1,789,093	15,851,363.98	0.14
338	600282	南钢股份	3,739,800	15,707,160.00	0.14
339	000987	越秀资本	2,281,938	15,654,094.68	0.14
340	000951	中国重汽	890,300	15,651,474.00	0.14
341	002507	涪陵榨菜	1,223,061	15,642,950.19	0.14
342	300529	健帆生物	724,434	15,626,041.38	0.14
343	600754	锦江酒店	695,582	15,608,860.08	0.14
344	002756	永兴材料	490,787	15,582,487.25	0.14
345	600598	北大荒	1,079,900	15,572,158.00	0.14
346	600271	航天信息	1,684,006	15,560,215.44	0.14
347	601001	晋控煤业	1,267,600	15,490,072.00	0.14
348	300601	康泰生物	1,017,284	15,452,543.96	0.14
349	688234	天岳先进	263,457	15,425,407.35	0.14
350	600737	中粮糖业	1,624,186	15,348,557.70	0.13
351	000559	万向钱潮	2,005,616	15,342,962.40	0.13
352	600739	辽宁成大	1,391,800	15,309,800.00	0.13
353	301536	星宸科技	253,100	15,261,930.00	0.13
354	601918	新集能源	2,357,400	15,228,804.00	0.13
355	688363	华熙生物	295,318	15,164,579.30	0.13
356	600582	天地科技	2,512,400	15,049,276.00	0.13
357	002429	兆驰股份	3,434,389	15,042,623.82	0.13
358	603290	斯达半导	183,617	14,922,553.59	0.13
359	601333	广深铁路	5,143,100	14,863,559.00	0.13
360	300070	碧水源	3,298,038	14,841,171.00	0.13
361	600566	济川药业	560,100	14,747,433.00	0.13
362	688772	珠海冠宇	1,031,111	14,734,576.19	0.13
363	601866	中远海发	5,960,316	14,721,980.52	0.13
364	002120	韵达股份	2,196,799	14,718,553.30	0.13

365	600764	中国海防	430,601	14,640,434.00	0.13
366	300735	光弘科技	583,200	14,638,320.00	0.13
367	601231	环旭电子	999,900	14,628,537.00	0.13
368	600867	通化东宝	1,781,100	14,605,020.00	0.13
369	300751	迈为股份	209,100	14,544,996.00	0.13
370	603341	龙旗科技	356,500	14,484,595.00	0.13
371	603728	鸣志电器	251,800	14,470,946.00	0.13
372	300888	稳健医疗	352,028	14,468,350.80	0.13
373	002430	杭氧股份	743,984	14,448,169.28	0.13
374	603688	石英股份	410,120	14,444,426.40	0.13
375	688778	厦钨新能	257,976	14,426,017.92	0.13
376	600329	达仁堂	431,809	14,405,148.24	0.13
377	600258	首旅酒店	1,016,931	14,369,235.03	0.13
378	003031	中瓷电子	269,342	14,331,687.82	0.13
379	601098	中南传媒	1,091,200	14,316,544.00	0.13
380	600995	南网储能	1,454,700	14,226,966.00	0.12
381	601212	白银有色	4,489,800	14,053,074.00	0.12
382	600707	彩虹股份	2,175,000	14,050,500.00	0.12
383	000032	深桑达 A	692,746	14,014,251.58	0.12
384	688561	奇安信	410,081	13,934,552.38	0.12
385	000027	深圳能源	2,162,566	13,797,171.08	0.12
386	688676	金盘科技	412,384	13,794,244.80	0.12
387	600578	京能电力	3,048,400	13,687,316.00	0.12
388	603858	步长制药	837,561	13,601,990.64	0.12
389	002508	老板电器	714,100	13,575,041.00	0.12
390	000709	河钢股份	6,272,768	13,549,178.88	0.12
391	688318	财富趋势	117,771	13,534,243.32	0.12
392	002299	圣农发展	942,911	13,474,198.19	0.12
393	603529	爱玛科技	391,200	13,457,280.00	0.12
394	600906	财达证券	1,969,591	13,432,610.62	0.12
395	301498	乖宝宠物	122,700	13,419,699.00	0.12
396	300573	兴齐眼药	258,197	13,372,022.63	0.12
397	000967	盈峰环境	1,921,664	13,355,564.80	0.12
398	000883	湖北能源	2,958,758	13,343,998.58	0.12
399	600517	国网英大	2,599,400	13,256,940.00	0.12
400	002831	裕同科技	565,557	13,245,344.94	0.12
401	002670	国盛金控	879,788	13,240,809.40	0.12
402	600848	上海临港	1,452,752	13,176,460.64	0.12
403	600546	山煤国际	1,504,400	13,133,412.00	0.12
404	601399	国机重装	4,377,700	13,133,100.00	0.12
405	600959	江苏有线	3,792,470	13,046,096.80	0.11
406	601928	凤凰传媒	1,160,300	12,960,551.00	0.11
407	601156	东航物流	963,363	12,610,421.67	0.11

408	600968	海油发展	3,081,100	12,570,888.00	0.11
409	600808	马钢股份	3,631,900	12,530,055.00	0.11
410	000825	太钢不锈	3,463,972	12,435,659.48	0.11
411	300595	欧普康视	814,112	12,431,490.24	0.11
412	600528	中铁工业	1,682,510	12,416,923.80	0.11
413	000739	普洛药业	886,105	12,405,470.00	0.11
414	603225	新凤鸣	1,158,616	12,339,260.40	0.11
415	002572	索菲亚	875,664	12,268,052.64	0.11
416	601118	海南橡胶	2,593,700	12,242,264.00	0.11
417	601636	旗滨集团	2,443,000	12,239,430.00	0.11
418	301301	川宁生物	1,015,465	12,226,198.60	0.11
419	002266	浙富控股	3,960,015	12,196,846.20	0.11
420	600977	中国电影	1,134,700	12,163,984.00	0.11
421	603565	中谷物流	1,272,500	12,152,375.00	0.11
422	601608	中信重工	2,777,643	12,138,299.91	0.11
423	600801	华新水泥	1,020,313	12,080,505.92	0.11
424	000543	皖能电力	1,717,200	12,020,400.00	0.11
425	600871	石化油服	6,164,300	12,020,385.00	0.11
426	600062	华润双鹤	631,946	11,792,112.36	0.10
427	601598	中国外运	2,391,900	11,792,067.00	0.10
428	600056	中国医药	1,136,487	11,751,275.58	0.10
429	688387	信科移动	2,076,044	11,729,648.60	0.10
430	688563	航材股份	206,922	11,717,992.86	0.10
431	601106	中国一重	4,159,500	11,646,600.00	0.10
432	603650	彤程新材	362,168	11,643,701.20	0.10
433	000582	北部湾港	1,411,100	11,641,575.00	0.10
434	000785	居然智家	3,777,886	11,522,552.30	0.10
435	688702	盛科通信	188,529	11,515,351.32	0.10
436	603233	大参林	693,276	11,300,398.80	0.10
437	300957	贝泰妮	254,700	11,262,834.00	0.10
438	600925	苏能股份	2,111,800	11,044,714.00	0.10
439	600373	中文传媒	1,059,200	10,877,984.00	0.10
440	601965	中国汽研	610,200	10,831,050.00	0.10
441	002153	石基信息	1,239,880	10,737,360.80	0.09
442	000429	粤高速 A	791,000	10,544,030.00	0.09
443	000537	中绿电	1,252,013	10,466,828.68	0.09
444	600606	绿地控股	6,392,500	10,419,775.00	0.09
445	688281	华秦科技	167,114	10,112,068.14	0.09
446	002372	伟星新材	966,180	10,009,624.80	0.09
447	601568	北元集团	2,410,400	10,003,160.00	0.09
448	600098	广州发展	1,597,300	9,983,125.00	0.09
449	600361	创新新材	2,493,300	9,948,267.00	0.09
450	001286	陕西能源	1,139,600	9,914,520.00	0.09

451	688425	铁建重工	2,427,485	9,904,138.80	0.09
452	600612	老凤祥	194,500	9,676,375.00	0.09
453	603658	安图生物	257,700	9,663,750.00	0.08
454	003022	联泓新科	609,180	9,643,319.40	0.08
455	600688	上海石化	3,335,000	9,504,750.00	0.08
456	000937	冀中能源	1,609,822	9,256,476.50	0.08
457	688349	三一重能	365,956	9,126,942.64	0.08
458	301165	锐捷网络	146,400	8,997,744.00	0.08
459	601019	山东出版	949,675	8,993,422.25	0.08
460	002608	江苏国信	1,148,248	8,416,657.84	0.07
461	000898	鞍钢股份	3,619,130	8,396,381.60	0.07
462	688100	威胜信息	226,090	8,376,634.50	0.07
463	601139	深圳燃气	1,307,800	8,317,608.00	0.07
464	600339	中油工程	2,542,300	8,313,321.00	0.07
465	600032	浙江新能	1,095,800	8,284,248.00	0.07
466	603707	健友股份	732,859	8,171,377.85	0.07
467	688248	南网科技	259,664	8,169,029.44	0.07
468	600720	中交设计	1,045,200	8,079,396.00	0.07
469	000959	首钢股份	2,358,140	8,017,676.00	0.07
470	600928	西安银行	2,023,700	7,932,904.00	0.07
471	003035	南网能源	1,721,674	7,902,483.66	0.07
472	600295	鄂尔多斯	898,376	7,824,854.96	0.07
473	688475	萤石网络	241,409	7,609,211.68	0.07
474	002461	珠江啤酒	673,500	7,603,815.00	0.07
475	688032	禾迈股份	76,070	7,596,350.20	0.07
476	603556	海兴电力	293,100	7,465,257.00	0.07
477	601228	广州港	2,287,700	7,389,271.00	0.06
478	301267	华夏眼科	381,224	7,308,064.08	0.06
479	688375	国博电子	118,761	7,126,847.61	0.06
480	688172	燕东微	358,749	7,053,005.34	0.06
481	603786	科博达	123,900	6,865,299.00	0.06
482	600927	永安期货	441,200	6,534,172.00	0.06
483	601061	中信金属	816,100	6,455,351.00	0.06
484	002563	森马服饰	1,223,800	6,437,188.00	0.06
485	600007	中国国贸	303,700	6,250,146.00	0.05
486	000539	粤电力 A	1,349,700	6,127,638.00	0.05
487	600299	安迪苏	611,700	5,902,905.00	0.05
488	002945	华林证券	408,769	5,874,010.53	0.05
489	300140	节能环保	940,000	5,799,800.00	0.05
490	603826	坤彩科技	296,220	5,797,025.40	0.05
491	688819	天能股份	208,599	5,790,708.24	0.05
492	001213	中铁特货	1,347,400	5,470,444.00	0.05
493	601921	浙版传媒	676,300	5,450,978.00	0.05

494	601858	中国科传	237,300	4,615,485.00	0.04
495	688153	唯捷创芯	131,913	4,090,622.13	0.04
496	601158	重庆水务	872,800	4,049,792.00	0.04
497	600956	新天绿能	466,500	3,601,380.00	0.03
498	001389	广合科技	58,700	3,449,799.00	0.03
499	688295	中复神鹰	151,743	3,156,254.40	0.03
500	603868	飞科电器	73,505	2,636,624.35	0.02

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	400174	中天3	3,046,725	1,218,690.00	0.01
2	688775	影石创新	573	71,143.68	0.00
3	688411	海博思创	560	46,754.40	0.00
4	603049	中策橡胶	724	31,023.40	0.00
5	688545	兴福电子	994	26,788.30	0.00
6	301275	汉朔科技	397	22,307.43	0.00
7	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
8	001388	信通电子	937	15,385.54	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	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	688220	翱捷科技	70,250,466.19	0.59
2	688578	艾力斯	63,938,055.20	0.54
3	688521	芯原股份	56,600,719.88	0.47
4	688114	华大智造	56,366,250.67	0.47
5	688099	晶晨股份	55,303,273.52	0.46
6	600418	江淮汽车	54,211,671.00	0.45
7	688525	佰维存储	52,354,030.65	0.44
8	603893	瑞芯微	51,280,559.96	0.43
9	688608	恒玄科技	49,657,165.35	0.42
10	688235	百济神州	46,449,101.90	0.39
11	689009	九号公司	40,971,954.33	0.34
12	688002	睿创微纳	40,699,254.98	0.34
13	688065	凯赛生物	40,236,312.08	0.34

14	000933	神火股份	39,289,071.00	0.33
15	688363	华熙生物	38,535,410.39	0.32
16	300450	先导智能	36,149,177.00	0.30
17	688297	中无人机	34,958,347.98	0.29
18	002130	沃尔核材	34,271,876.26	0.29
19	600363	联创光电	34,182,642.00	0.29
20	300454	深信服	33,631,233.40	0.28

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	600418	江淮汽车	178,104,802.44	1.49
2	002625	光启技术	87,287,668.52	0.73
3	688220	翱捷科技	69,387,765.95	0.58
4	688578	艾力斯	67,025,361.94	0.56
5	002384	东山精密	66,613,793.52	0.56
6	688521	芯原股份	62,079,676.75	0.52
7	688099	晶晨股份	60,375,248.74	0.51
8	688114	华大智造	59,807,325.01	0.50
9	603893	瑞芯微	58,157,744.00	0.49
10	688525	佰维存储	54,484,383.64	0.46
11	301236	软通动力	46,015,762.80	0.39
12	688002	睿创微纳	43,967,509.20	0.37
13	688047	龙芯中科	42,255,741.61	0.35
14	600642	申能股份	42,008,273.70	0.35
15	601567	三星医疗	41,660,437.84	0.35
16	600839	四川长虹	40,340,043.00	0.34
17	689009	九号公司	39,880,182.85	0.33
18	688363	华熙生物	39,609,087.65	0.33
19	300866	安克创新	39,335,330.96	0.33
20	688065	凯赛生物	37,383,842.38	0.31

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	5,362,174,248.42
卖出股票收入（成交）总额	5,746,634,590.57

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）	124,108.16	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	124,108.16	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	1,241	124,108.16	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

本基金为指数型基金，主要投资标的为指数成份股和备选成份股。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金投资于标的指数为基础资产的股指期货，目的在于满足基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，实现跟踪标的指数的投资目标。

本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，并符合既定的投资政策和投资目标。

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，东吴证券股份有限公司、苏州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

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	26,574,668.24
2	应收清算款	119,686,891.61
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	146,261,559.85

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	400174	中天3	1,218,690.00	0.01	重大事项停牌
2	688775	影石创新	71,143.68	0.00	新股锁定
3	688411	海博思创	46,754.40	0.00	新股锁定
4	603049	中策橡胶	31,023.40	0.00	新股锁定
5	688545	兴福电子	26,788.30	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, 115	237, 219. 82	4, 375, 401, 950. 00	91. 70	396, 274, 815. 00	8. 30

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 500 交易型开放式 指数证券投资基金联接基金	705, 236, 248. 00	14. 78

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	中央汇金投资有限责 任公司	2, 310, 720, 380. 00	48. 43
2	北京诚通金控投资有 限公司	157, 937, 000. 00	3. 31
3	中国平安人寿保险股 份有限公司一分红一 个险分红	137, 429, 978. 00	2. 88
4	中国平安人寿保险股 份有限公司一自有资 金	124, 783, 500. 00	2. 62
5	大家人寿保险股份有 限公司一万能产品	103, 852, 774. 00	2. 18
6	漳州市国有资本运营 集团有限公司	101, 000, 000. 00	2. 12
7	大家人寿保险股份有 限公司一传统产品	61, 119, 268. 00	1. 28
8	中国人寿保险股份有 限公司	60, 836, 108. 00	1. 27
9	中国平安人寿保险股 份有限公司一万能一 个险万能	42, 956, 800. 00	0. 90
10	海港人寿保险股份有	42, 000, 000. 00	0. 88

	限公司—H 传统 2		
11	嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	705,236,248.00	14.78

注：上述基金持有人份额均为场内基金份额。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013 年 2 月 6 日）基金份额总额	3,108,729,402.00
本报告期期初基金份额总额	5,222,676,765.00
本报告期基金总申购份额	2,700,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	3,151,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	4,771,676,765.00

§ 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

中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。

陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省

分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

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，会计师事务所为德勤华永会计师事务所（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

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信建投证券股份有限公司	6	5,032,800,818.30	45.31	181,032.70	45.30	—
华泰证券股份有限公司	1	3,710,185,591.33	33.40	133,481.53	33.40	—
广发证券股份有限公司	5	1,939,469,055.02	17.46	69,811.53	17.47	—
招商证券股份有限公司	1	425,077,117.85	3.83	15,265.72	3.82	—
长江证券股份有限公司	1	—	—	—	—	—

公司						
东北证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
高盛高华证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国泰海通证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国投证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国元证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华福证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
开源证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	2	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
银泰证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中航证券有限公司	2	-	-	-	-	-
中信证券股份有限	1	-	-	-	-	-

公司						
----	--	--	--	--	--	--

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。

4. 报告期内，本基金退租以下交易单元：国投证券股份有限公司退租交易单元 2 个。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
中信建投证券股份有限公司	467,291.50	8.88	360,000,000.00	100.00	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	4,795,790.96	91.12	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

长江证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
东北证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
高盛高 华证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
光大证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国泰海 通证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
国投证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国元证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
华福证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-
开源证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证券 有限公 司	-	-	-	-	-	-
西部证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-

兴业证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
银泰证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-
浙商证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
中航证 券有限 公司	-	-	-	-	-	-
中信证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	嘉实基金管理有限公司关于调整证券投资基金主流动性服务商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 2 月 25 日
2	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 2 月 28 日
3	关于嘉实基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 3 月 19 日
4	关于嘉实中证 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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 5 月 21 日
5	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 5 月 22 日
6	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 6 月 30 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(%)
机构	1	2025-01-01 至 2025-06-30	2,310,720,380.00	-	-	2,310,720,380.00	48.43
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) 中国证监会核准嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- (2) 《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实中证 500 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

- 1) 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) 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼中国建设银行投资托管业务部

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