

嘉实中证 500 指数增强型证券投资基金 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：中信建投证券股份有限公司

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。

基金托管人中信建投证券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	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	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	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47

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	47
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	47
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	47
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	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	48
§ 8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
8.3 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	49
§ 9 开放式基金份额变动	50
§ 10 重大事件揭示	50
10.1 基金份额持有人大会决议	50
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	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
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	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	51
10.8 其他重大事件	52
§ 11 备查文件目录	52
11.1 备查文件目录	52
11.2 存放地点	52
11.3 查阅方式	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	嘉实中证 500 指数增强	
基金主代码	008778	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 1 月 20 日	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	中信建投证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	86,767,725.82 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉实中证 500 指数增强 A	嘉实中证 500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	008778	008779
报告期末下属分级基金的份额总额	49,783,412.70 份	36,984,313.12 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金作为增强指数型基金，采取量化方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力求有效跟踪标的指数，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.75%的基础上，实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为增强型指数基金，主要利用全市场多因子选股模型，在保持对基准指数紧密跟踪的前提下力争实现对基准指数长期超越。增强策略由风险模型、Alpha 模型以及组合优化构成。风险模型：基于中国股票市场特性，通过风险预测和对主动风险敞口的控制，如市场、行业和风格等，力争将投资组合的跟踪误差控制在目标范围内。Alpha 模型：基于量化模型构建选股策略，从估值、成长、营运质量、动量、流动性等多维度刻画股票特征，选取最具投资价值的个股。量化投资团队对各维度因子进行持续跟踪与深入研究，分析其适用条件和背后的驱动机理，在市场状态发生变化的情况下及时对模型做出调整，力争实现模型的长期有效。其他策略包括资产配置策略、债券投资策略、衍生品投资策略、资产支持证券投资策略、融资及转融通证券出借、存托凭证投资策略。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95% + 银行活期存款税后利率×5%
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

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		中信建投证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	郭松	朱志明
	联系电话	(010)65215588	4008-888-108
	电子邮箱	service@jsfund.cn	service@csc.com.cn
客户服务电话	400-600-8800		95587
传真	(010)65215588		010-56162085
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		北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼
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		北京市朝阳区景辉街 16 号院 1 号楼泰康集团大厦 8 层/18 层，北京市朝阳区光华路 10 号院中信大厦 82 层
邮政编码	100020		100010
法定代表人	经雷		刘成

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	嘉实基金管理有限公司	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

§ 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)	
	嘉实中证 500 指数增强 A	嘉实中证 500 指数增强 C
本期已实现收益	2, 543, 209. 71	1, 550, 497. 94
本期利润	4, 470, 717. 89	3, 206, 040. 22
加权平均基金份 额本期利润	0. 0835	0. 0904
本期加权平均净 值利润率	6. 97%	7. 70%
本期基金份额净	6. 88%	6. 66%

值增长率		
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	12,947,976.37	8,616,659.84
期末可供分配基金份额利润	0.2601	0.2330
期末基金资产净值	62,731,389.07	45,600,972.96
期末基金份额净值	1.2601	1.2330
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	26.01%	23.30%

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

嘉实中证 500 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	4.98%	0.69%	4.09%	0.75%	0.89%	-0.06%
过去三个月	3.08%	1.42%	0.97%	1.43%	2.11%	-0.01%
过去六个月	6.88%	1.25%	3.21%	1.29%	3.67%	-0.04%
过去一年	16.77%	1.50%	18.83%	1.64%	-2.06%	-0.14%
过去三年	-10.57%	1.22%	-7.61%	1.29%	-2.96%	-0.07%
自基金合同生效起至今	26.01%	1.25%	7.72%	1.31%	18.29%	-0.06%

嘉实中证 500 指数增强 C

阶段	份额净	份额净值	业绩比较基	业绩比较基准	①－③	②－④
----	-----	------	-------	--------	-----	-----

	值增长率①	增长率标准差②	准收益率③	收益率标准差④		
过去一个月	4.95%	0.69%	4.09%	0.75%	0.86%	-0.06%
过去三个月	2.97%	1.42%	0.97%	1.43%	2.00%	-0.01%
过去六个月	6.66%	1.25%	3.21%	1.29%	3.45%	-0.04%
过去一年	16.30%	1.50%	18.83%	1.64%	-2.53%	-0.14%
过去三年	-11.64%	1.22%	-7.61%	1.29%	-4.03%	-0.07%
自基金合同生效起至今	23.30%	1.25%	7.72%	1.31%	15.58%	-0.06%

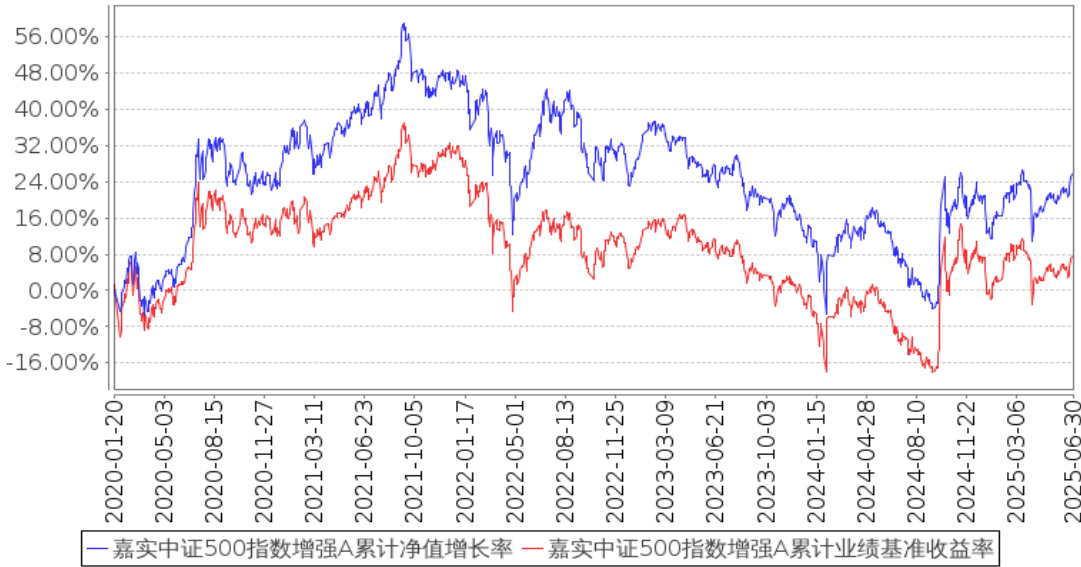
注：本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

$$\text{Return}(t) = (\text{中证 500 指数}(t) / \text{中证 500 指数}(t-1) - 1) \times 95\% + ((1 + \text{银行活期存款税后利率})^{1/365} - 1) \times 5\%$$
$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) \times (1 + \text{Benchmark}(t-1)) - 1$$

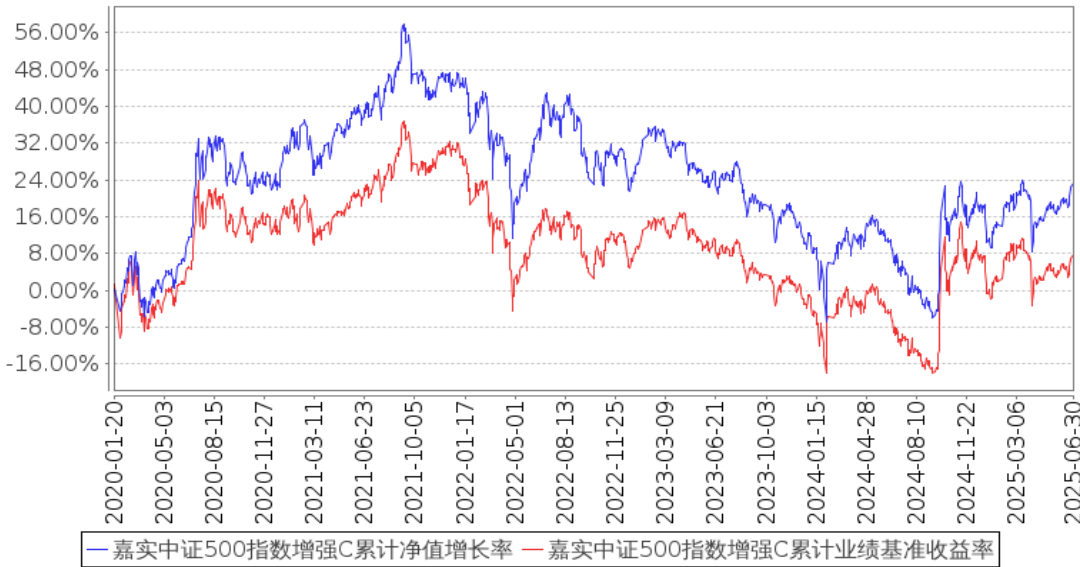
其中， $t = 1, 2, 3, \dots, T$ ， T 表示时间截至日。

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

嘉实中证500指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2020年01月20日至2025年06月30日)



嘉实中证500指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2020年01月20日至2025年06月30日)



注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 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		
龙昌 伦	本基金、 嘉实量化	2020 年 1 月 20 日	-	11 年	曾任职于建信基金管理有限责任公司投资管理部，从事量化研究工作。2015 年 4 月

阿尔法混合、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实沪深300指数研究增强、嘉实量化精选股票、嘉实创业板增强策略ETF、嘉实中证1000指数增强发起式、嘉实中证A100指数增强发起式、嘉实上证科创板综合增强策略ETF基金经理				加入嘉实基金管理有限公司，现任职于股票投研体系。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
龙昌伦	公募基金	9	2,696,848,147.87	2018年9月12日
	私募资产管理计划	1	21,603,261.72	2022年7月19日
	其他组合	3	14,793,610,277.47	2017年3月13日
	合计	13	17,512,061,687.06	-

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，龙昌伦管理的1个私募资产管理计划已于2025年3月13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 指数增强型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

2025 年上半年，A 股市场在复杂的内外部环境展现出较强的韧性。市场整体呈现震荡上行态势，上证指数累计上涨 2.76%，深证成指与创业板指微弱正收益，而北证 50 指数则以 39.45% 的涨幅创出历史新高，呈现出巨大的分化差异。与此同时，市场的阶段性特征比较显著：年初在政策预期推动下展开春季行情，4 月遭遇关税冲击导致指数大幅下挫，随后在政策托底和中美谈判进展顺利的推动下逐步企稳回升，最终在 6 月底突破年内新高。

从市场结构来看，呈现出鲜明的哑铃型双主线特征。一方面，银行、有色金属等板块表现强势；另一方面，AI 产业链等科技题材反复活跃，特别是互联网巨头对 AI 算力基础设施投资增加。与此同时，煤炭、食品饮料等偏内需的板块持续承压，地产链也仍处于寻底阶段。港股市场表现亮眼，新消费 IP 标的涨幅惊人，展现出强大的市场吸引力。

宏观层面呈现出内需修复偏弱、外需回落以及政策稳预期的总体特征。国内经济正处于新旧动能转换期，二季度末工业增加值、社融等指标的回暖释放出积极信号，但企业盈利仍受通胀缺

口压制。海外方面，特朗普关税政策的反复与美欧制造业的边际回暖形成对冲，美债利率高位震荡对全球风险资产估值形成制约。这种复杂的宏观环境使得市场风格经历了从哑铃向多热点扩散的转变，成长风格逐渐显现弹性，表现突出。行业方面，有色金属、银行、国防军工、传媒和通信等涨幅居前，建筑装饰、石油石化、房地产、食品饮料和煤炭等则表现靠后。

本基金主要利用全市场多因子选股模型，在保持对基准指数紧密跟踪的前提下力争实现对基准指数长期超越。报告期内，基金保持仓位稳定，以获取超额收益为核心。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实中证 500 指数增强 A 基金份额净值为 1.2601 元，本报告期基金份额净值增长率为 6.88%；截至本报告期末嘉实中证 500 指数增强 C 基金份额净值为 1.2330 元，本报告期基金份额净值增长率为 6.66%；业绩比较基准收益率为 3.21%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，A 股市场预计呈现中枢上移以及延续结构轮动的特征。随着外部环境边际改善，包括中美经贸关系短期缓和、美联储降息预期增强以及地缘风险阶段性缓解，市场风险偏好有望持续修复。从宏观角度看，国内政策托底效应逐渐显现，消费刺激政策与基建投资保持较高增速，但盈利弹性受制于地产拖累和经济转型压力。在这种环境下，市场风格有望从上半年的红利和小微盘的哑铃结构向部分成长板块切换，科技和先进制造等高弹性领域可能领涨市场。值得注意的是，增量资金持续进入 A 股，推动市场成交放量，若后续出现财政和货币协同发力、地产企稳等催化剂，市场可能从结构性行情向指数机会扩散，与此同时，部分大市值核心资产在盈利改善与估值修复的驱动下已显现配置价值。综合来看，A 股有望在政策支持与经济转型中震荡上行，重点关注业绩确定性强的成长板块，同时把握可能出现风格扩散带来的指数机会，风险层面，需警惕贸易谈判的反复和国内经济修复不及预期等潜在冲击。

具体操作上，本基金将继续在行业中性的框架内坚持自下而上精选个股的投资策略，在控制指数跟踪误差的同时力争为持有人创造更多的超额收益。

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

在本报告期内，本基金托管人在托管本基金过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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

在本报告期内，本基金托管人按照相关法律法规、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、基金费用开支方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对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

本报告中财务指标、净值收益表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告的数据真实、准确和完整（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分，以及涉及关联方和基金份额持有人信息等相关数据未在托管人复核范围内）。

§ 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 指数增强型证券投资基金

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	7,681,238.32	8,144,365.23
结算备付金		434,366.48	88,244.94
存出保证金		140,817.60	137,270.40

交易性金融资产	6.4.7.2	100,699,507.64	97,622,210.57
其中：股票投资		100,195,021.06	97,622,210.57
基金投资		—	—
债券投资		504,486.58	—
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		9,108.87	158,878.48
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.8	—	—
资产总计		108,965,038.91	106,150,969.62
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		—	—
应付赎回款		433,001.56	409,612.46
应付管理人报酬		88,014.99	89,602.53
应付托管费		17,602.99	17,920.52
应付销售服务费		14,975.75	13,974.20
应付投资顾问费		—	—
应交税费		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.9	79,081.59	85,009.45
负债合计		632,676.88	616,119.16
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	86,767,725.82	90,187,484.02
未分配利润	6.4.7.12	21,564,636.21	15,347,366.44
净资产合计		108,332,362.03	105,534,850.46
负债和净资产总计		108,965,038.91	106,150,969.62

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，嘉实中证 500 指数增强 A 基金份额净值 1.2601 元，基金份额总额 49,783,412.70 份，嘉实中证 500 指数增强 C 基金份额净值 1.2330 元，基金份额总额 36,984,313.12 份，基金份额总额合计为 86,767,725.82 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实中证 500 指数增强型证券投资基金

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		8,478,839.39	-4,972,969.09
1. 利息收入		12,237.20	14,760.92
其中：存款利息收入	6.4.7.13	12,237.20	14,760.92
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）		4,871,840.23	-6,166,237.56
其中：股票投资收益	6.4.7.14	3,701,502.77	-7,568,119.39
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	10,288.46	458.40
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-51,875.47	-
股利收益	6.4.7.19	1,211,924.47	1,401,423.43
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	3,583,050.46	1,158,112.44
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	11,711.50	20,395.11
减：二、营业总支出		802,081.28	885,371.49
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	524,922.04	506,389.51
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	104,984.38	101,277.84
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	82,617.08	82,177.80

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		-	1. 72
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	89, 557. 78	195, 524. 62
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7, 676, 758. 11	-5, 858, 340. 58
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7, 676, 758. 11	-5, 858, 340. 58
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		7, 676, 758. 11	-5, 858, 340. 58

6.3 净资产变动表

会计主体：嘉实中证 500 指数增强型证券投资基金

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	90, 187, 484. 02	-	15, 347, 366. 44	105, 534, 850. 46
二、本期期初净资产	90, 187, 484. 02	-	15, 347, 366. 44	105, 534, 850. 46
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3, 419, 758. 20	-	6, 217, 269. 77	2, 797, 511. 57
（一）、综合收益总额	-	-	7, 676, 758. 11	7, 676, 758. 11
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-3, 419, 758. 20	-	-1, 459, 488. 34	-4, 879, 246. 54
其中：1. 基金申购款	18, 692, 739. 28	-	2, 959, 991. 28	21, 652, 730. 56
2. 基金赎回款	-22, 112, 497. 48	-	-4, 419, 479. 62	-26, 531, 977. 10
（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	86,767,725.82	-	21,564,636.21	108,332,362.03
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	94,690,646.29	-	12,714,101.38	107,404,747.67
二、本期期初净资产	94,690,646.29	-	12,714,101.38	107,404,747.67
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-4,375,375.41	-	-6,270,226.26	-10,645,601.67
（一）、综合收益总额	-	-	-5,858,340.58	-5,858,340.58
（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）	-4,375,375.41	-	-411,885.68	-4,787,261.09
其中：1. 基金申购款	14,860,149.55	-	1,493,673.91	16,353,823.46
2. 基金赎回款	-19,235,524.96	-	-1,905,559.59	-21,141,084.55
（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	90,315,270.88	-	6,443,875.12	96,759,146.00

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 指数增强型证券投资基金(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[2019]2772 号《关于准予嘉实中证 500 指数增强型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 500 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定。经向中国证监会备案,《嘉实中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2020 年 1 月 20 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 455,702,086.93 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,基金托管人为中信建投证券股份有限公司。

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	1,012,459.78
等于：本金	1,012,200.60
加：应计利息	259.18
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	6,668,778.54
等于：本金	6,668,675.98
加：应计利息	102.56
减：坏账准备	-
合计	7,681,238.32

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		97,601,466.43	-	100,195,021.06	2,593,554.63
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	499,470.00	4,536.58	504,486.58	480.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	499,470.00	4,536.58	504,486.58	480.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		98,100,936.43	4,536.58	100,699,507.64	2,594,034.63

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	1,116,440.00	-	-	
其中：股指期货投资	1,116,440.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	1,116,440.00	-	-	

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	1.00	1,173,480.00	57,040.00
合计				57,040.00
减：可抵销期货暂收款				57,040.00
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	168.13
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	76,863.46
其他	2,050.00
合计	79,081.59

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

嘉实中证 500 指数增强 A

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	55,554,763.98	55,554,763.98
本期申购	5,469,875.81	5,469,875.81
本期赎回（以“-”号填列）	-11,241,227.09	-11,241,227.09
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	49,783,412.70	49,783,412.70

嘉实中证 500 指数增强 C

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	34,632,720.04	34,632,720.04
本期申购	13,222,863.47	13,222,863.47
本期赎回（以“-”号填列）	-10,871,270.39	-10,871,270.39
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	36,984,313.12	36,984,313.12

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

嘉实中证 500 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	21,348,617.56	-11,402,617.51	9,946,000.05
本期期初	21,348,617.56	-11,402,617.51	9,946,000.05
本期利润	2,543,209.71	1,927,508.18	4,470,717.89
本期基金份额交易产生的变动数	-2,366,375.35	897,633.78	-1,468,741.57
其中：基金申购款	2,148,023.46	-1,183,768.73	964,254.73
基金赎回款	-4,514,398.81	2,081,402.51	-2,432,996.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	21,525,451.92	-8,577,475.55	12,947,976.37

嘉实中证 500 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	12,495,438.68	-7,094,072.29	5,401,366.39

本期期初	12,495,438.68	-7,094,072.29	5,401,366.39
本期利润	1,550,497.94	1,655,542.28	3,206,040.22
本期基金份额交易产生的变动数	953,741.01	-944,487.78	9,253.23
其中：基金申购款	5,041,000.94	-3,045,264.39	1,995,736.55
基金赎回款	-4,087,259.93	2,100,776.61	-1,986,483.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,999,677.63	-6,383,017.79	8,616,659.84

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	8,583.89
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,966.81
结算备付金利息收入	1,384.21
其他	302.29
合计	12,237.20

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	3,701,502.77
股票投资收益——赎回差价收入	-
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	3,701,502.77

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	151,797,244.05
减：卖出股票成本总额	147,942,134.85
减：交易费用	153,606.43
买卖股票差价收入	3,701,502.77

6.4.7.14.3 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	1,980.63
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	8,307.83
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	10,288.46

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	48,620.79
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	40,300.00
减：应计利息总额	12.96
减：交易费用	—
买卖债券差价收入	8,307.83

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	-51,875.47

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	1,211,924.47
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	1,211,924.47

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	3,502,890.46
股票投资	3,502,410.46
债券投资	480.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-

2. 衍生工具	80,160.00
权证投资	-
期货投资	80,160.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	3,583,050.46

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	8,692.03
基金转出费收入	3,019.47
合计	11,711.50

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	17,356.09
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
债券托管账户维护费	9,000.00
指数使用费	3,694.32
合计	89,557.78

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
中信建投证券股份有限公司（“中信建投”）	基金托管人

证券”)	
嘉实财富管理有限公司(“嘉实财富”)	基金管理人的控股子公司

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	524,922.04	506,389.51
其中：应支付销售机构的客户维护费	144,959.92	136,444.96
应支付基金管理人的净管理费	379,962.12	369,944.55

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 1.00%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×1.00%/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	104,984.38	101,277.84

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20%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×0.20%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实中证 500 指数增强 A	嘉实中证 500 指数增强 C	合计
嘉实基金管理有限公司	-	13,987.76	13,987.76
中信建投证券	-	5,213.89	5,213.89
嘉实财富	-	73.40	73.40
合计	-	19,275.05	19,275.05
获得销售服务费的各关联方名称	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销售服务费		
	嘉实中证 500 指数增强 A	嘉实中证 500 指数增强 C	合计
嘉实基金管理有限公司	-	6,333.36	6,333.36
中信建投证券	-	5,923.79	5,923.79
嘉实财富	-	73.68	73.68
合计	-	12,330.83	12,330.83

注：（1）本基金 C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付给嘉实基金管理有限公司，再由嘉实基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：C 类基金份额日销售服务费=C 类基金份额前一日基金资产净值×0.40%/当年天数。（2）本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。

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

无。

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
中信建投证券股份有限公司_活期	1,012,459.78	8,583.89	1,858,394.53	7,207.41

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

无。

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 risk 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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末	上年度末
--------	-----	------

	2025 年 6 月 30 日	2024 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	504,486.58	-
合计	504,486.58	-

注：评级取自第三方评级机构。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

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

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

比例限制)。

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	7,681,238.32	-	-	-	7,681,238.32
结算备付金	434,366.48	-	-	-	434,366.48
存出保证金	-	-	-	140,817.60	140,817.60
交易性金融资产	504,486.58	-	-	100,195,021.06	100,699,507.64
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	-	-	-	9,108.87	9,108.87
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	8,620,091.38	-	-	100,344,947.53	108,965,038.91
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	433,001.56	433,001.56
应付管理人报酬	-	-	-	88,014.99	88,014.99
应付托管费	-	-	-	17,602.99	17,602.99
应付销售服务费	-	-	-	14,975.75	14,975.75
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	-	-	-	79,081.59	79,081.59
负债总计	-	-	-	632,676.88	632,676.88
利率敏感度缺口	8,620,091.38	-	-	99,712,270.65	108,332,362.03
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	8,144,365.23	-	-	-	8,144,365.23
结算备付金	88,244.94	-	-	-	88,244.94
存出保证金	-	-	-	137,270.40	137,270.40
交易性金融资产	-	-	-	97,622,210.57	97,622,210.57
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	-	-	-	158,878.48	158,878.48
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	8,232,610.17	-	-	97,918,359.45	106,150,969.62
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	409,612.46	409,612.46

应付管理人报酬	-	-	-	89,602.53	89,602.53
应付托管费	-	-	-	17,920.52	17,920.52
应付销售服务费	-	-	-	13,974.20	13,974.20
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	-	-	-	85,009.45	85,009.45
负债总计	-	-	-	616,119.16	616,119.16
利率敏感度缺口	8,232,610.17	-	-	97,302,240.29	105,534,850.46

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	-409.06	-
	市场利率下降 25 个基点	409.72	-

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	100,195,021.06	92.49	97,622,210.57	92.50
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	100,195,021.06	92.49	97,622,210.57	92.50

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	5,207,410.36	4,763,850.19

	5%		
	业绩比较基准下降	-5, 207, 410. 36	-4, 763, 850. 19
	5%		

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	100, 195, 021. 06	97, 622, 210. 57
第二层次	504, 486. 58	-
第三层次	-	-
合计	100, 699, 507. 64	97, 622, 210. 57

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	100,195,021.06	91.95
	其中：股票	100,195,021.06	91.95
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	504,486.58	0.46
	其中：债券	504,486.58	0.46
	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	8,115,604.80	7.45
8	其他各项资产	149,926.47	0.14
9	合计	108,965,038.91	100.00

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	-	-
B	采矿业	5,618,561.50	5.19
C	制造业	50,914,262.95	47.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,225,458.00	2.98
E	建筑业	497,802.00	0.46
F	批发和零售业	1,638,675.00	1.51
G	交通运输、仓储和邮政业	456,841.00	0.42
H	住宿和餐饮业	291,078.00	0.27
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,392,154.94	6.82

J	金融业	7,803,054.27	7.20
K	房地产业	1,384,205.00	1.28
L	租赁和商务服务业	831,501.00	0.77
M	科学研究和技术服务业	347,900.00	0.32
N	水利、环境和公共设施管理业	258,104.00	0.24
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	1,336,632.00	1.23
S	综合	-	-
	合计	81,996,229.66	75.69

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	363,744.00	0.34
C	制造业	12,794,118.40	11.81
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	199,977.00	0.18
G	交通运输、仓储和邮政业	518,668.00	0.48
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,495,733.00	1.38
J	金融业	1,626,632.00	1.50
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	744,480.00	0.69
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	455,439.00	0.42
S	综合	-	-
	合计	18,198,791.40	16.80

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	000988	华工科技	35,800	1,682,958.00	1.55
2	300017	网宿科技	132,000	1,415,040.00	1.31
3	300496	中科创达	23,400	1,338,948.00	1.24
4	002138	顺络电子	47,000	1,321,640.00	1.22
5	688608	恒玄科技	3,620	1,259,687.60	1.16
6	600316	洪都航空	33,400	1,259,180.00	1.16
7	601555	东吴证券	140,900	1,232,875.00	1.14
8	600096	云天化	54,300	1,192,971.00	1.10
9	688114	华大智造	18,400	1,192,872.00	1.10
10	300207	欣旺达	59,400	1,191,564.00	1.10
11	002085	万丰奥威	74,500	1,183,805.00	1.09
12	603737	三棵树	31,947	1,177,246.95	1.09
13	688122	西部超导	22,500	1,167,300.00	1.08
14	603379	三美股份	24,100	1,159,692.00	1.07
15	600578	京能电力	240,300	1,078,947.00	1.00
16	300677	英科医疗	45,100	1,067,968.00	0.99
17	603979	金诚信	21,400	993,816.00	0.92
18	002155	湖南黄金	52,070	929,449.50	0.86
19	300623	捷捷微电	29,900	891,020.00	0.82
20	600968	海油发展	211,500	862,920.00	0.80
21	000415	渤海租赁	249,700	831,501.00	0.77
22	600487	亨通光电	52,400	801,720.00	0.74
23	601168	西部矿业	48,000	798,240.00	0.74
24	688100	威胜信息	20,500	759,525.00	0.70
25	002532	天山铝业	91,300	758,703.00	0.70
26	600098	广州发展	121,100	756,875.00	0.70
27	002739	万达电影	62,600	715,518.00	0.66
28	000750	国海证券	173,300	713,996.00	0.66
29	688213	思特威	6,927	708,077.94	0.65
30	002202	金风科技	67,900	695,975.00	0.64
31	688617	惠泰医疗	2,320	689,040.00	0.64

32	688099	晶晨股份	9,500	674,595.00	0.62
33	688475	萤石网络	21,300	671,376.00	0.62
34	600685	中船防务	24,500	666,155.00	0.61
35	603816	顾家家居	26,100	666,072.00	0.61
36	600998	九州通	126,400	649,696.00	0.60
37	000050	深天马 A	73,400	625,368.00	0.58
38	600873	梅花生物	58,000	620,020.00	0.57
39	600637	东方明珠	81,900	611,793.00	0.56
40	002156	通富微电	22,500	576,450.00	0.53
41	002273	水晶光电	28,700	573,139.00	0.53
42	600563	法拉电子	5,200	567,268.00	0.52
43	600299	安迪苏	57,400	553,910.00	0.51
44	600380	健康元	50,100	552,603.00	0.51
45	002517	恺英网络	28,600	552,266.00	0.51
46	601615	明阳智能	47,000	540,030.00	0.50
47	600143	金发科技	52,200	538,182.00	0.50
48	000598	兴蓉环境	73,900	532,819.00	0.49
49	600177	雅戈尔	71,700	523,410.00	0.48
50	688578	艾力斯	5,600	521,024.00	0.48
51	603596	伯特利	9,800	516,362.00	0.48
52	300037	新宙邦	14,400	506,880.00	0.47
53	300395	菲利华	9,900	505,890.00	0.47
54	603298	杭叉集团	24,100	504,895.00	0.47
55	600606	绿地控股	305,400	497,802.00	0.46
56	601128	常熟银行	66,671	491,365.27	0.45
57	002414	高德红外	47,700	488,925.00	0.45
58	000783	长江证券	70,200	486,486.00	0.45
59	601216	君正集团	88,100	486,312.00	0.45
60	688582	芯动联科	7,000	470,400.00	0.43
61	600079	人福医药	22,400	469,952.00	0.43
62	600988	赤峰黄金	18,700	465,256.00	0.43
63	601156	东航物流	34,900	456,841.00	0.42
64	600298	安琪酵母	12,900	453,693.00	0.42
65	300604	长川科技	10,100	453,591.00	0.42
66	000729	燕京啤酒	35,000	452,550.00	0.42
67	002353	杰瑞股份	12,900	451,500.00	0.42
68	601456	国联民生	43,100	446,085.00	0.41
69	300002	神州泰岳	37,800	446,040.00	0.41
70	000423	东阿阿胶	8,500	444,550.00	0.41
71	002409	雅克科技	8,000	437,520.00	0.40
72	600895	张江高科	16,800	431,760.00	0.40
73	601155	新城控股	31,500	430,920.00	0.40
74	600862	中航高科	16,500	430,320.00	0.40

75	000825	太钢不锈	119,500	429,005.00	0.40
76	000009	中国宝安	47,900	425,352.00	0.39
77	600885	宏发股份	19,040	424,782.40	0.39
78	601198	东兴证券	37,900	422,585.00	0.39
79	603338	浙江鼎力	8,800	417,120.00	0.39
80	600398	海澜之家	59,900	416,904.00	0.38
81	600038	中直股份	10,700	415,267.00	0.38
82	600582	天地科技	68,400	409,716.00	0.38
83	601918	新集能源	63,200	408,272.00	0.38
84	000709	河钢股份	188,500	407,160.00	0.38
85	300339	润和软件	7,800	396,474.00	0.37
86	600352	浙江龙盛	38,800	394,208.00	0.36
87	600535	天士力	25,100	392,815.00	0.36
88	002340	格林美	61,700	391,795.00	0.36
89	000921	海信家电	15,200	390,640.00	0.36
90	600498	烽火通信	18,300	384,849.00	0.36
91	002595	豪迈科技	6,300	373,086.00	0.34
92	600348	华阳股份	56,000	372,960.00	0.34
93	603160	汇顶科技	5,200	369,356.00	0.34
94	601098	中南传媒	28,100	368,672.00	0.34
95	601665	齐鲁银行	57,300	362,136.00	0.33
96	600517	国网英大	69,700	355,470.00	0.33
97	603345	安井食品	4,400	353,848.00	0.33
98	603939	益丰药房	14,400	352,368.00	0.33
99	600901	江苏金租	57,900	350,874.00	0.32
100	601717	郑煤机	21,100	350,682.00	0.32
101	601965	中国汽研	19,600	347,900.00	0.32
102	600909	华安证券	58,900	343,387.00	0.32
103	000831	中国稀土	9,300	335,916.00	0.31
104	603087	甘李药业	6,000	328,680.00	0.30
105	300529	健帆生物	15,200	327,864.00	0.30
106	601991	大唐发电	102,800	325,876.00	0.30
107	002472	双环传动	9,600	321,504.00	0.30
108	600707	彩虹股份	49,600	320,416.00	0.30
109	000563	陕国投 A	89,100	318,087.00	0.29
110	000893	亚钾国际	10,200	307,428.00	0.28
111	002841	视源股份	8,800	304,480.00	0.28
112	600060	海信视像	13,200	303,864.00	0.28
113	600704	物产中大	57,400	302,498.00	0.28
114	601001	晋控煤业	24,200	295,724.00	0.27
115	000021	深科技	15,600	292,344.00	0.27
116	600258	首旅酒店	20,600	291,078.00	0.27
117	601958	金钼股份	26,200	286,628.00	0.26

118	603650	彤程新材	8,800	282,920.00	0.26
119	603486	科沃斯	4,800	279,504.00	0.26
120	002244	滨江集团	28,500	277,875.00	0.26
121	688188	柏楚电子	2,100	276,486.00	0.26
122	601568	北元集团	65,800	273,070.00	0.25
123	688772	珠海冠宇	19,100	272,939.00	0.25
124	600062	华润双鹤	14,300	266,838.00	0.25
125	601577	长沙银行	26,800	266,392.00	0.25
126	300735	光弘科技	10,500	263,550.00	0.24
127	600801	华新水泥	21,800	258,112.00	0.24
128	002266	浙富控股	83,800	258,104.00	0.24
129	600109	国金证券	29,400	257,838.00	0.24
130	600166	福田汽车	95,000	257,450.00	0.24
131	002821	凯莱英	2,900	255,925.00	0.24
132	600499	科达制造	26,000	254,800.00	0.24
133	600271	航天信息	27,500	254,100.00	0.23
134	601928	凤凰传媒	22,600	252,442.00	0.23
135	600131	国网信通	14,000	247,800.00	0.23
136	600959	江苏有线	71,400	245,616.00	0.23
137	000027	深圳能源	38,400	244,992.00	0.23
138	600663	陆家嘴	27,500	243,650.00	0.22
139	601990	南京证券	29,800	240,784.00	0.22
140	603606	东方电缆	4,600	237,866.00	0.22
141	002958	青农商行	64,600	233,206.00	0.22
142	600528	中铁工业	31,300	230,994.00	0.21
143	000960	锡业股份	14,900	227,970.00	0.21
144	688002	睿创微纳	3,200	223,104.00	0.21
145	000887	中鼎股份	12,600	221,634.00	0.20
146	601099	太平洋	54,800	215,364.00	0.20
147	688469	芯联集成	44,400	211,788.00	0.20
148	688819	天能股份	7,600	210,976.00	0.19
149	300373	扬杰科技	4,000	207,600.00	0.19
150	600583	海油工程	37,600	205,296.00	0.19
151	002500	山西证券	34,800	203,232.00	0.19
152	002223	鱼跃医疗	5,700	202,920.00	0.19
153	603858	步长制药	12,000	194,880.00	0.18
154	600118	中国卫星	6,800	194,276.00	0.18
155	601696	中银证券	17,400	186,006.00	0.17
156	688676	金盘科技	5,500	183,975.00	0.17
157	600511	国药股份	6,300	183,708.00	0.17
158	300024	机器人	10,600	182,108.00	0.17
159	002008	大族激光	7,200	175,464.00	0.16
160	000898	鞍钢股份	72,600	168,432.00	0.16

161	002432	九安医疗	4,600	167,578.00	0.15
162	603529	爱玛科技	4,800	165,120.00	0.15
163	600295	鄂尔多斯	18,800	163,748.00	0.15
164	300054	鼎龙股份	5,500	157,740.00	0.15
165	600655	豫园股份	27,100	150,405.00	0.14
166	300595	欧普康视	9,600	146,592.00	0.14
167	600021	上海电力	16,300	143,277.00	0.13
168	600483	福能股份	14,800	142,672.00	0.13
169	601231	环旭电子	9,200	134,596.00	0.12
170	000728	国元证券	16,200	127,818.00	0.12
171	002673	西部证券	15,700	123,716.00	0.11
172	688278	特宝生物	1,700	122,587.00	0.11
173	000830	鲁西化工	11,900	122,570.00	0.11
174	002410	广联达	8,400	112,644.00	0.10
175	688777	中控技术	2,500	112,275.00	0.10
176	002444	巨星科技	4,300	109,693.00	0.10

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	002625	光启技术	25,500	1,019,490.00	0.94
2	688041	海光信息	7,200	1,017,288.00	0.94
3	300134	大富科技	83,000	1,015,090.00	0.94
4	002811	郑中设计	70,500	744,480.00	0.69
5	688026	洁特生物	44,416	728,422.40	0.67
6	000001	平安银行	60,000	724,200.00	0.67
7	688512	慧智微	50,900	555,319.00	0.51
8	601519	大智慧	52,600	535,994.00	0.49
9	002407	多氟多	40,900	498,571.00	0.46
10	000538	云南白药	7,900	440,741.00	0.41
11	603380	易德龙	15,500	412,300.00	0.38
12	601166	兴业银行	15,700	366,438.00	0.34
13	600099	林海股份	33,600	364,224.00	0.34
14	603993	洛阳钼业	43,200	363,744.00	0.34
15	601567	三星医疗	15,100	338,542.00	0.31
16	300369	绿盟科技	42,500	330,225.00	0.30
17	603665	康隆达	13,000	322,140.00	0.30
18	605365	立达信	20,900	307,857.00	0.28
19	603201	常润股份	16,400	302,580.00	0.28
20	002606	大连电瓷	31,800	283,656.00	0.26
21	601919	中远海控	18,600	279,744.00	0.26
22	000404	长虹华意	38,900	276,190.00	0.25
23	603466	风语筑	27,200	274,448.00	0.25
24	603236	移远通信	3,000	257,400.00	0.24

25	002983	芯瑞达	11,700	247,923.00	0.23
26	603617	君禾股份	33,700	241,629.00	0.22
27	002001	新 和 成	11,300	240,351.00	0.22
28	002352	顺丰控股	4,900	238,924.00	0.22
29	688590	新致软件	11,400	234,156.00	0.22
30	600066	宇通客车	9,400	233,684.00	0.22
31	688008	澜起科技	2,800	229,600.00	0.21
32	000401	冀东水泥	51,500	225,570.00	0.21
33	603668	天马科技	17,100	225,378.00	0.21
34	002405	四维图新	25,800	220,332.00	0.20
35	603203	快克智能	8,700	216,369.00	0.20
36	002230	科大讯飞	4,500	215,460.00	0.20
37	300319	麦捷科技	19,200	206,208.00	0.19
38	000551	创元科技	16,000	205,600.00	0.19
39	000715	中兴商业	34,900	199,977.00	0.18
40	600660	福耀玻璃	3,500	199,535.00	0.18
41	002368	太极股份	8,400	196,728.00	0.18
42	603185	弘元绿能	13,100	194,535.00	0.18
43	603755	日辰股份	7,200	188,064.00	0.17
44	603889	新澳股份	32,400	187,920.00	0.17
45	300133	华策影视	24,100	180,991.00	0.17
46	688231	隆达股份	10,000	180,500.00	0.17
47	600609	金杯汽车	31,600	167,164.00	0.15
48	688018	乐鑫科技	1,120	163,632.00	0.15
49	300616	尚品宅配	12,200	160,674.00	0.15
50	002408	齐翔腾达	35,400	158,592.00	0.15
51	600305	恒顺醋业	20,500	158,465.00	0.15
52	002225	濮耐股份	31,700	156,915.00	0.14
53	688312	燕麦科技	5,800	139,374.00	0.13
54	300737	科顺股份	28,200	135,924.00	0.13
55	300098	高新兴	26,000	135,200.00	0.12
56	301028	东亚机械	10,400	127,816.00	0.12
57	688087	英科再生	4,700	120,790.00	0.11
58	603609	禾丰股份	12,800	105,728.00	0.10

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	600316	洪都航空	1,735,071.00	1.64
2	002625	光启技术	1,623,684.00	1.54
3	000988	华工科技	1,591,015.00	1.51
4	300496	中科创达	1,438,783.00	1.36

5	300017	网宿科技	1,427,479.00	1.35
6	002085	万丰奥威	1,370,012.00	1.30
7	688608	恒玄科技	1,310,331.85	1.24
8	002155	湖南黄金	1,283,252.00	1.22
9	300134	大富科技	1,264,742.00	1.20
10	603737	三棵树	1,241,443.01	1.18
11	002384	东山精密	1,220,806.00	1.16
12	688114	华大智造	1,202,373.63	1.14
13	603379	三美股份	1,120,241.00	1.06
14	600578	京能电力	1,071,098.00	1.01
15	688041	海光信息	989,824.34	0.94
16	603893	瑞芯微	972,808.00	0.92
17	603920	世运电路	937,155.00	0.89
18	300251	光线传媒	930,116.00	0.88
19	300677	英科医疗	921,734.00	0.87
20	603979	金诚信	849,173.00	0.80

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	002384	东山精密	1,725,721.00	1.64
2	600418	江淮汽车	1,586,927.00	1.50
3	300476	胜宏科技	1,574,251.00	1.49
4	300573	兴齐眼药	1,215,868.60	1.15
5	300724	捷佳伟创	1,211,441.00	1.15
6	600988	赤峰黄金	1,141,641.00	1.08
7	600435	北方导航	1,116,659.00	1.06
8	603893	瑞芯微	946,046.00	0.90
9	600536	中国软件	941,892.00	0.89
10	603920	世运电路	938,697.00	0.89
11	002281	光迅科技	912,165.00	0.86
12	300611	美力科技	886,131.00	0.84
13	688521	芯原股份	859,131.86	0.81
14	300251	光线传媒	855,780.00	0.81
15	601108	财通证券	829,650.00	0.79
16	688516	奥特维	801,429.80	0.76
17	000883	湖北能源	787,526.00	0.75
18	600282	南钢股份	786,558.00	0.75
19	000039	中集集团	784,556.00	0.74
20	002579	中京电子	784,309.00	0.74

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	147,012,534.88
--------------	----------------

卖出股票收入（成交）总额	151,797,244.05
--------------	----------------

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	504,486.58	0.47
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	504,486.58	0.47

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	019758	24 国债 21	5,000	504,486.58	0.47

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

本基金投资股指期货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	140,817.60
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	9,108.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	149,926.47

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

无。

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

份额单位：份

份额级别	持有人 户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)
嘉实中证 500 指数 增强 A	2,162	23,026.56	-	-	49,783,412.70	100.00
嘉实中证 500 指数 增强 C	6,596	5,607.08	54.15	0.00	36,984,258.97	100.00
合计	8,636	10,047.21	54.15	0.00	86,767,671.67	100.00

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管 理人所有从业 人员持有本基 金	嘉实中证 500 指数增强 A	114,374.32	0.23
	嘉实中证 500 指数增强 C	25,565.33	0.07
	合计	139,939.65	0.16

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、 基金投资和研究部门 负责人持有本开放式 基金	嘉实中证 500 指数增强 A	0
	嘉实中证 500 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有 本开放式基金	嘉实中证 500 指数增强 A	0
	嘉实中证 500 指数增强 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实中证 500 指数增强 A	嘉实中证 500 指数增强 C
基金合同生效日 (2020 年 1 月 20 日) 基金份额总额	196,864,056.96	258,838,029.97
本报告期期初基金份 额总额	55,554,763.98	34,632,720.04
本报告期基金总申购 份额	5,469,875.81	13,222,863.47
减：本报告期基金总 赎回份额	11,241,227.09	10,871,270.39
本报告期基金拆分变 动份额	—	—
本报告期期末基金份 额总额	49,783,412.70	36,984,313.12

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

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

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
东兴证券股份有限公司	2	298,809,778.93	100.00	58,542.19	100.00	-
中信建投证券股份有限公司	7	-	-	-	-	-

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。

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	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 (%)				的比例 (%)
东兴证券股份有限公司	548,090.79	100.00	—	—	—	—
中信建投证券股份有限公司	—	—	—	—	—	—

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	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
2	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 5 月 22 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予嘉实中证 500 指数增强型证券投资基金注册的批复文件；
- (2) 《嘉实中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- (4) 《嘉实中证 500 指数增强型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 500 指数增强型证券投资基金公告的各项原稿。

11.2 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

11.3 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